

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年12月27日提出
【計算期間】	第23期(自 2023年10月3日至 2024年9月30日)
【ファンド名】	D C日本株式インデックス・オープン
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、わが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）に連動する投資成果を目指します。

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニ ア				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))	その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1)国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5)資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3)ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1)インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

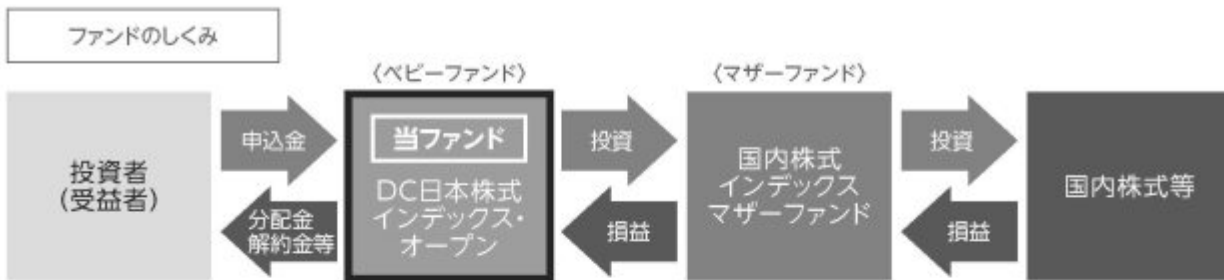
[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

1. わが国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。



? ファミリーファンド方式とは

ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてペーパーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場している株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. TOPIX(東証株価指数)(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

? TOPIX(東証株価指数)とは

株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の著作権等について

- 1．TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。
- 2．JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIXに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- 3．JPXは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- 4．JPXは、配当込みTOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- 5．本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではない。
- 6．JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- 7．JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- 8．以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は行いません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1日

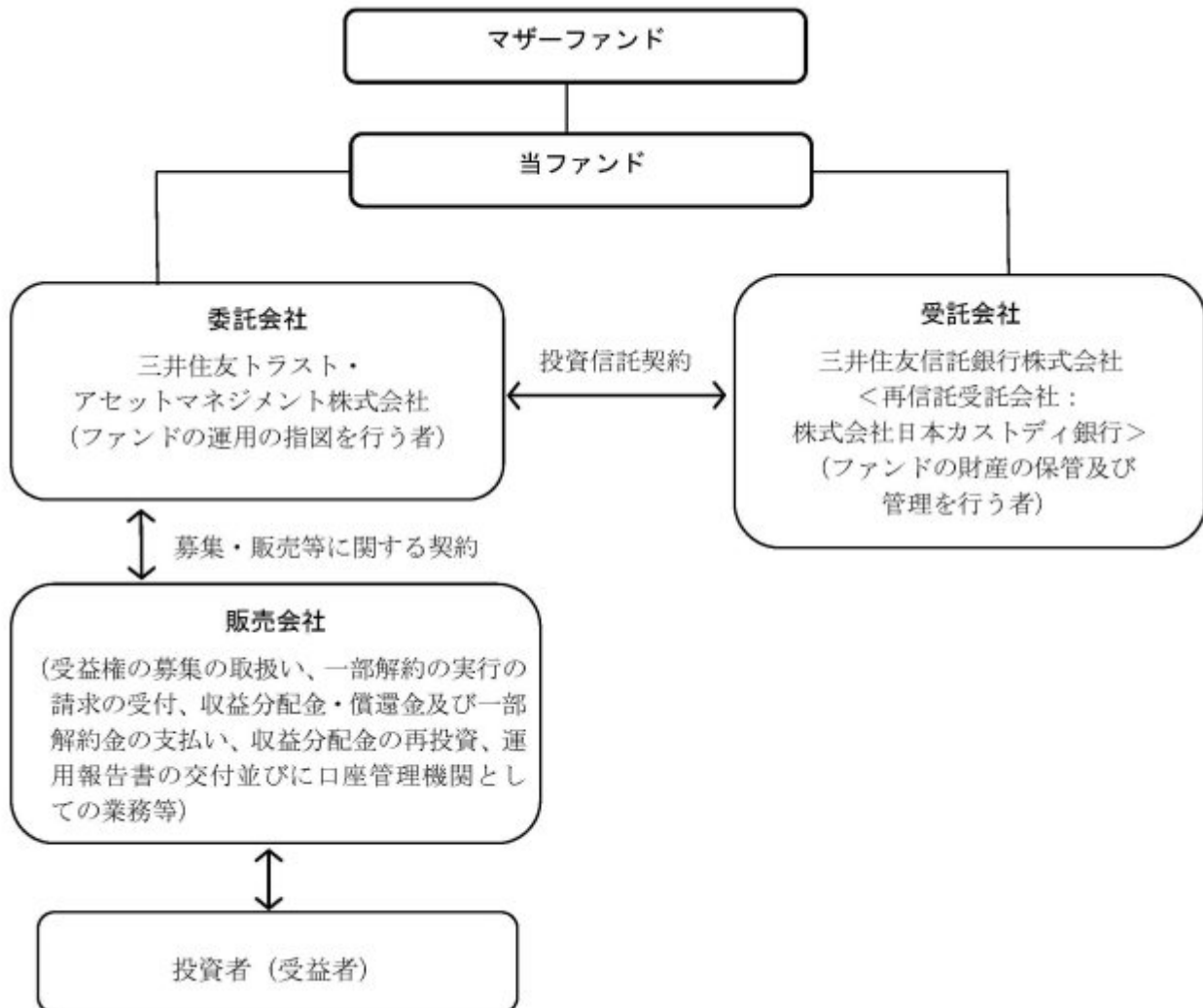
本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2012年4月 1日

本ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープン」から「DC日本株式インデックス・オープン」に変更
 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年10月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- | | |
|-------------|---|
| 1986年11月1日： | 住信キャピタルマネジメント株式会社設立 |
| 1987年2月20日： | 投資顧問業の登録 |
| 1987年9月9日： | 投資一任契約に係る業務の認可 |
| 1990年10月1日： | 住信投資顧問株式会社に商号変更 |
| 1999年2月15日： | 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 1999年3月25日： | 証券投資信託委託業の認可 |
| 2007年9月30日： | 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号） |
| 2012年4月1日： | 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更 |

2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

八．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(イ)基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ)運用方法

投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 5)国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

(イ)本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- (八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二)前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(ハ)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3.運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

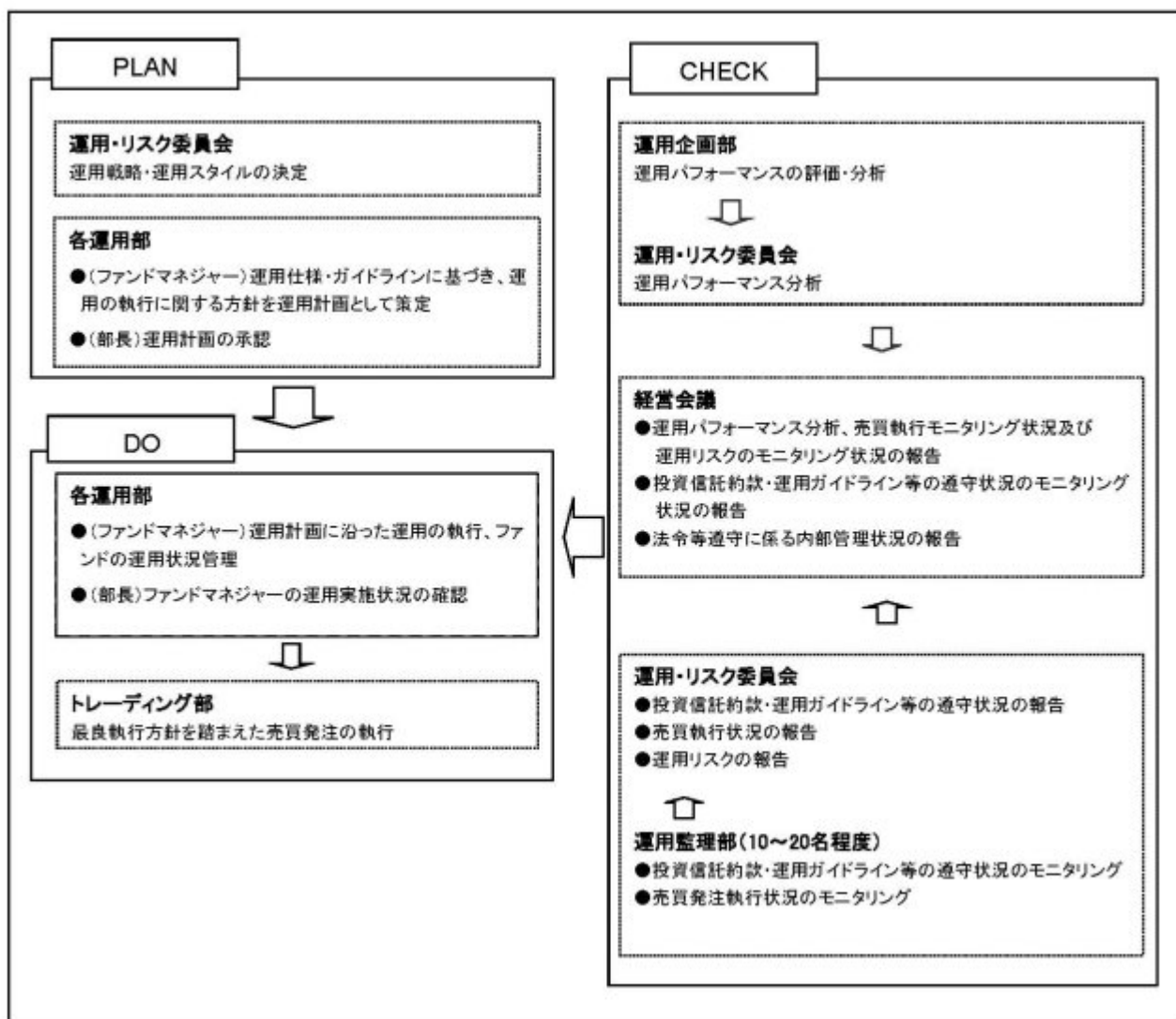
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式

等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを

行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

- ・ 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権

の行使により取得可能な株券

6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとしします。（投資信託約款第23条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第24条）

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとしします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとしします。

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとしします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度としします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととしします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度としします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第32条）

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととしします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

前記 および から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 および から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落するこ

とになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【参考情報】

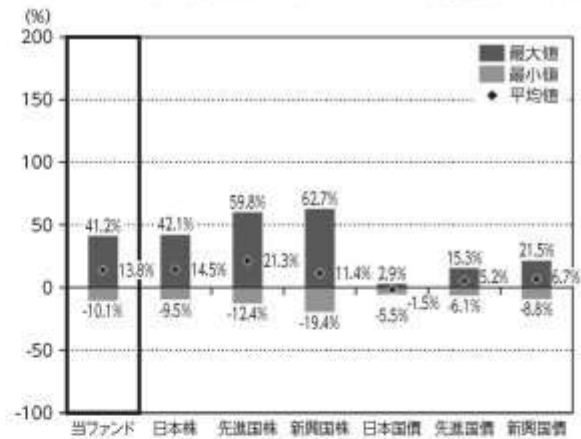
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年11月～2024年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、連動性ベースの特定資産加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利又はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中絶に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を測る投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、右用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMエレガント・バリエーション・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.2035%（税抜 0.185%）（ ）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1045% （税抜 0.095%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.066% （税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年12月27日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2024年10月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.21%	0.20%	0.01%

※対象期間は2023年10月3日～2024年9月30日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値（年率）です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年10月31日現在の状況について記載してあります。

【D C 日本株式インデックス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	16,937,608,396	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,498,908	0.05
合計（純資産総額）		16,946,107,304	100.00

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

（注2）投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	5,986,712,992	2.7769	16,624,503,308	2.8292	16,937,608,396	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第14期計算期間末	(2015年 9月30日)	5,422,952,362	5,422,952,362	15,686	15,686
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	5,729,227,131	5,729,227,131	14,927	14,927
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	7,330,898,749	7,330,898,749	19,167	19,167
第17期計算期間末	(2018年10月 1日)	8,669,330,919	8,669,330,919	21,134	21,134
第18期計算期間末	(2019年 9月30日)	8,364,659,058	8,364,659,058	18,809	18,809
第19期計算期間末	(2020年 9月30日)	9,080,247,496	9,080,247,496	19,598	19,598
第20期計算期間末	(2021年 9月30日)	11,675,630,077	11,675,630,077	24,826	24,826
第21期計算期間末	(2022年 9月30日)	11,452,235,853	11,452,235,853	22,902	22,902
第22期計算期間末	(2023年10月 2日)	14,330,417,977	14,330,417,977	29,446	29,446
第23期計算期間末	(2024年 9月30日)	16,690,842,286	16,690,842,286	34,380	34,380
	2023年10月末日	14,041,394,441		28,673	
	11月末日	14,648,193,843		30,217	
	12月末日	14,632,330,038		30,147	
	2024年 1月末日	15,685,614,851		32,493	
	2月末日	16,542,766,156		34,086	
	3月末日	17,249,294,796		35,590	
	4月末日	17,192,042,295		35,267	
	5月末日	17,295,147,732		35,662	
	6月末日	17,464,139,203		36,172	
	7月末日	17,399,477,891		35,970	
	8月末日	17,008,931,617		34,921	
	9月末日	16,690,842,286		34,380	

10月末日	16,946,107,304		35,021
-------	----------------	--	--------

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0
第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	0
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	7.7
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	4.8
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	28.4
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	10.3
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	11.0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	4.2
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	26.7
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	7.7
第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	28.6
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	16.8

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,497,444,507	1,115,886,709	3,457,146,429
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,215,333,947	834,369,525	3,838,110,851
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,128,218,267	1,141,666,812	3,824,662,306
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,122,120,183	844,769,825	4,102,012,664
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	1,105,861,467	760,666,529	4,447,207,602
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	1,310,633,921	1,124,605,757	4,633,235,766
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	1,083,018,794	1,013,364,344	4,702,890,216
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	1,020,279,867	722,712,080	5,000,458,003
第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	677,822,602	811,623,529	4,866,657,076
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	794,837,896	806,682,194	4,854,812,778

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	674,843,963,800	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,624,682,907	1.84
合計(純資産総額)		687,468,646,707	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	12,313,865,000	1.79

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,271,300	3,347.13	31,032,246,369	2,682.50	24,870,262,250	3.62
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,265,200	1,626.54	18,323,313,180	1,628.50	18,345,378,200	2.67
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,535,900	3,227.32	14,638,836,649	3,924.00	17,798,871,600	2.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,107,600	2,502.31	15,283,108,556	2,723.50	16,634,048,600	2.42
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,398,800	7,881.03	11,023,986,625	9,533.00	13,334,760,400	1.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,500	69,643.48	12,152,787,260	69,780.00	12,176,610,000	1.77
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,583,400	3,329.13	11,929,604,442	3,273.00	11,728,468,200	1.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,543,200	3,326.78	11,787,446,896	2,835.50	10,046,743,600	1.46
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,240,400	7,265.08	9,011,605,232	7,653.00	9,492,781,200	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,677,100	5,348.30	8,969,633,930	5,568.00	9,338,092,800	1.36
日本	株式	信越化学工業	化学	1,566,600	5,895.22	9,235,451,652	5,755.00	9,015,783,000	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	1,101,100	8,241.53	9,074,748,683	8,145.00	8,968,459,500	1.30
日本	株式	三井物産	卸売業	2,764,200	3,970.25	10,974,565,050	3,162.00	8,740,400,400	1.27
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,100	34,923.45	12,890,245,395	23,400.00	8,636,940,000	1.26
日本	株式	第一三共	医薬品	1,650,800	5,426.01	8,957,272,800	4,981.00	8,222,634,800	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	862,900	8,912.16	7,690,302,864	9,498.00	8,195,824,200	1.19
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,030,100	151.83	7,899,730,083	147.70	7,684,845,770	1.12

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,318,500	3,116.27	7,225,071,995	3,212.00	7,447,022,000	1.08
日本	株式	HOYA	精密機器	343,300	18,642.05	6,399,815,765	20,725.00	7,114,892,500	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	3,080,400	1,329.27	4,094,683,308	2,193.00	6,755,317,200	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,556,400	4,110.00	6,396,804,000	4,264.00	6,636,489,600	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,132,300	1,725.66	7,130,944,818	1,557.50	6,436,057,250	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,286,600	4,285.47	5,513,685,702	4,778.00	6,147,374,800	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	27,986,600	187.48	5,246,927,768	192.80	5,395,816,480	0.78
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	103,800	40,382.22	4,191,674,436	49,520.00	5,140,176,000	0.75
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	549,600	5,902.93	3,244,252,350	9,148.00	5,027,740,800	0.73
日本	株式	富士通	電気機器	1,620,900	2,263.84	3,669,458,256	2,963.00	4,802,726,700	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,038,400	2,025.35	4,128,487,588	2,199.00	4,482,441,600	0.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,043,500	4,385.25	4,576,008,375	4,281.00	4,467,223,500	0.65
日本	株式	キャノン	電気機器	869,900	4,484.31	3,900,901,269	5,004.00	4,352,979,600	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.25
		建設業	2.08
		食料品	3.18
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.49
		医薬品	4.76
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.82
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.50
		機械	5.53
		電気機器	17.26
		輸送用機器	7.21
		精密機器	2.50
		その他製品	2.46
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.27
海運業	0.66		
空運業	0.35		
倉庫・運輸関連業	0.14		

	情報・通信業	7.41
	卸売業	6.91
	小売業	4.36
	銀行業	7.64
	証券、商品先物取引業	0.79
	保険業	3.10
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.84
	サービス業	4.92
	小計	98.16
合計		98.16

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	457円		12,039,037,350	12,313,865,000	1.79

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2001年10月1日
作成基準日：2024年10月31日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	35,021円
純資産総額	169.46億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年9月	0円
2021年9月	0円
2022年9月	0円
2023年10月	0円
2024年9月	0円
設定来 分配金合計額	0円

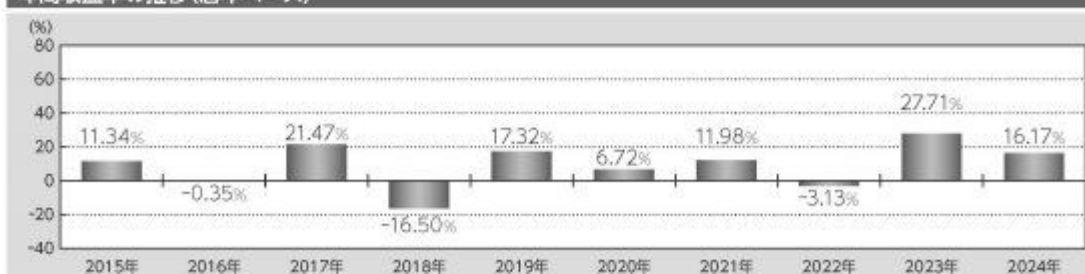
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.6%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.7%
日立製作所	日本	株式	電気機器	2.6%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.9%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.7%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.5%
伊藤忠商事	日本	株式	卸売業	1.4%
東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	1.4%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録

を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠出することとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行

の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記〈解約価額〉の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ(<https://www.smtam.jp/>)でご覧いただけます。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。(2001年10月1日設定)

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了(償還)と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。

- ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)における公告等の手続き

委託会社は上記(1)によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行いま

す。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ファンドの繰上償還において、上記からまでの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社

の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマースナル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間(2023年10月3日から2024年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 (2023年10月2日現在)	第23期 (2024年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,062,799	62,252,124
親投資信託受益証券	14,323,225,078	16,682,197,031
未収入金	8,672,151	8,459,619
未収利息	-	365
流動資産合計	14,370,960,028	16,752,909,139
資産合計	14,370,960,028	16,752,909,139
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,883,430	44,154,466
未払受託者報酬	2,997,055	2,762,122
未払委託者報酬	25,950,490	14,270,910
未払利息	67	-
その他未払費用	711,009	879,355
流動負債合計	40,542,051	62,066,853
負債合計	40,542,051	62,066,853
純資産の部		
元本等		
元本	4,866,657,076	4,854,812,778
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,463,760,901	11,836,029,508
(分配準備積立金)	4,476,179,955	5,901,590,611
元本等合計	14,330,417,977	16,690,842,286
純資産合計	14,330,417,977	16,690,842,286
負債純資産合計	14,370,960,028	16,752,909,139

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期		第23期	
	自	2022年10月 1日	自	2023年10月 3日
	至	2023年10月 2日	至	2024年 9月30日
営業収益				
受取利息		103		20,376
有価証券売買等損益		3,290,848,260		2,447,190,088
営業収益合計		3,290,848,363		2,447,210,464
営業費用				
支払利息		19,257		1,943
受託者報酬		6,309,369		5,276,875
委託者報酬		62,385,858		27,263,716
その他費用		711,009		879,355
営業費用合計		69,425,493		33,421,889
営業利益又は営業損失（ ）		3,221,422,870		2,413,788,575
経常利益又は経常損失（ ）		3,221,422,870		2,413,788,575
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,221,422,870		2,413,788,575
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		250,773,823		302,293,899
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,451,777,850		9,463,760,901
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,098,640,233		1,846,886,123
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,098,640,233		1,846,886,123
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,057,306,229		1,586,112,192
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,057,306,229		1,586,112,192
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,463,760,901		11,836,029,508

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第23期計算期間は2023年10月3日から2024年9月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第22期 (2023年10月2日現在)	第23期 (2024年9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,866,657,076口	4,854,812,778口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9446円 (29,446円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.4380円 (34,380円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自 2022年10月1日 至 2023年10月2日			第23期 自 2023年10月3日 至 2024年9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	18,148円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,243,852,377円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,111,461,316円
収益調整金額	C	6,733,374,360円	収益調整金額	C	7,392,162,555円
分配準備積立金額	D	2,232,327,578円	分配準備積立金額	D	3,790,111,147円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,209,554,315円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,293,753,166円
当ファンドの期末残存口数	F	4,866,657,076口	当ファンドの期末残存口数	F	4,854,812,778口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	23,033円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	27,382円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第23期 自 2023年10月3日 至 2024年9月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第23期 (2024年9月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第23期 (2024年 9月30日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第22期 自 2022年10月 1日 至 2023年10月 2日	第23期 自 2023年10月 3日 至 2024年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,000,458,003円	4,866,657,076円
期中追加設定元本額	677,822,602円	794,837,896円
期中一部解約元本額	811,623,529円	806,682,194円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第22期 (2023年10月 2日現在)	第23期 (2024年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,166,324,760	2,308,678,136
合計	3,166,324,760	2,308,678,136

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,007,489,298	16,682,197,031	
	合計	6,007,489,298	16,682,197,031	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,543,468,499
株式	661,440,523,950
派生商品評価勘定	183,693,900
未収入金	241,118,189
未収配当金	6,567,605,790
未収利息	32,583
差入委託証拠金	486,911,049
流動資産合計	674,463,353,960
資産合計	674,463,353,960
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	121,006,400
前受金	62,919,600
未払金	74,790,714
未払解約金	1,256,308,173
流動負債合計	1,515,024,887
負債合計	1,515,024,887
純資産の部	
元本等	
元本	242,341,869,199
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	430,606,459,874
元本等合計	672,948,329,073
純資産合計	672,948,329,073
負債純資産合計	674,463,353,960

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,341,869,199口
2. 1口当たり純資産額	2.7769円

	2024年 9月30日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(27,769円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

	区分	2024年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年10月 3日
期首元本額		241,361,431,252円
期中追加設定元本額		35,249,374,675円
期中一部解約元本額		34,268,936,728円
期末元本額		242,341,869,199円
期末元本額の内訳		
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）		269,464,585円
SBI資産設計オープン（資産成長型）		3,244,950,866円
SBI資産設計オープン（分配型）		12,133,051円

区分	2024年 9月30日現在
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,497,842,670円
世界経済インデックスファンド	6,653,714,429円
日本株式インデックス・オープン	2,765,780,661円
DCマイセレクション25	4,852,936,705円
DCマイセレクション50	16,358,007,142円
DCマイセレクション75	18,500,287,400円
DC日本株式インデックス・オープン	6,007,489,298円
DCマイセレクションS25	3,067,619,975円
DCマイセレクションS50	9,722,962,512円
DCマイセレクションS75	9,115,700,727円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,679,890,111円
DCターゲット・イヤーフンド2025	36,841,757円
DCターゲット・イヤーフンド2035	544,670,111円
DCターゲット・イヤーフンド2045	452,585,830円
DC世界経済インデックスファンド	3,677,700,468円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	388,546,908円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,619,540円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	8,427,170円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,766,275円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	94,763,235円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,891,172円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	10,915,598円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	44,028,752円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	12,846,382円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	40,018,082円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	338,920,010円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	279,770,776円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,890,650,523円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	25,473,660円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	9,218,030円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	284,694,786円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	155,155,354円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	212,971,710円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,840,106円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	361,060,805円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,443,556,351円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,908,744円
コア投資戦略ファンド(安定型)	526,088,837円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	690,840,629円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	420,971,781円
コア投資戦略ファンド(切替型)	434,167,482円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	188,858,693円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,716,937円
SMT インデックスバランス・オープン	46,420,449円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	16,874,133,482円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	189,957,492円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,693,244円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	266,284,586円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	43,172,878円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,782,375円
グローバル経済コア	296,098,220円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	35,086,746円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	3,099,244,666円
DCターゲット・イヤーフンド2055	31,797,516円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	442,995,610円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	129,749,321円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	65,925,018円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	69,730,044円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	31,564,734円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	40,294,206円

区分	2024年 9月30日現在
10資産分散投資ファンド	113,559,583円
グローバル10資産バランスファンド	48,798,340円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,189,444円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	158,581円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	34,978円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	198,906円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	60,994円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	44,599円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,495円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	31,132円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,854,987円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	43,975,323,665円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	234,681,472円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	303,394,456円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	22,442,918円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	50,480,491,273円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,038,740円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	216,978,126円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	21,088,509,232	
合計	21,088,509,232	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,109,530,400	-	11,172,450,000	62,919,600
合計		11,109,530,400	-	11,172,450,000	62,919,600

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	10,300	4,365.00	44,959,500	
ニッスイ	249,100	917.50	228,549,250	
マルハニチロ	37,000	3,171.00	117,327,000	

雪国まいたけ	21,200	1,001.00	21,221,200
カネコ種苗	7,000	1,390.00	9,730,000
サカタのタネ	28,300	3,530.00	99,899,000
ホクト	19,900	1,821.00	36,237,900
ホクリヨウ	900	1,008.00	907,200
住石ホールディングス	35,200	921.00	32,419,200
日鉄鉱業	10,000	4,270.00	42,700,000
三井松島ホールディングス	14,800	4,825.00	71,410,000
I N P E X	752,900	1,938.00	1,459,120,200
石油資源開発	144,500	1,042.00	150,569,000
K & O エナジーグループ	11,300	3,195.00	36,103,500
ショーボンドホールディングス	33,900	5,672.00	192,280,800
ミライト・ワン	75,200	2,124.00	159,724,800
タマホーム	15,700	4,010.00	62,957,000
サンヨーホームズ	600	719.00	431,400
日本アクア	2,700	906.00	2,446,200
ファーストコーポレーション	1,500	795.00	1,192,500
ベステラ	1,300	925.00	1,202,500
キャンディル	1,000	528.00	528,000
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,147.00	1,261,700
第一カッター興業	7,200	1,476.00	10,627,200
安藤・間	144,300	1,119.00	161,471,700
東急建設	78,000	706.00	55,068,000
コムシスホールディングス	79,500	3,125.00	248,437,500
ビーアールホールディングス	36,500	350.00	12,775,000
高松コンストラクショングループ	18,500	2,937.00	54,334,500
東建コーポレーション	6,300	11,300.00	71,190,000
ソネック	600	923.00	553,800
ヤマウラ	12,600	1,158.00	14,590,800
オリエンタル白石	92,200	390.00	35,958,000
大成建設	159,600	6,260.00	999,096,000
大林組	623,200	1,813.00	1,129,861,600
清水建設	494,100	983.50	485,947,350
飛島建設	18,000	1,439.00	25,902,000
長谷工コーポレーション	159,900	1,872.50	299,412,750
松井建設	16,300	771.00	12,567,300
銭高組	600	3,400.00	2,040,000
鹿島建設	386,400	2,675.50	1,033,813,200
不動テトラ	12,100	2,289.00	27,696,900
大末建設	1,500	1,604.00	2,406,000
鉄建建設	12,500	2,356.00	29,450,000
西松建設	33,200	5,087.00	168,888,400

三井住友建設	129,700	400.00	51,880,000
大豊建設	6,000	3,465.00	20,790,000
佐田建設	2,400	903.00	2,167,200
ナカノフドー建設	2,700	490.00	1,323,000
奥村組	28,300	4,340.00	122,822,000
東鉄工業	21,600	3,410.00	73,656,000
イチケン	900	2,485.00	2,236,500
富士ピー・エス	1,700	435.00	739,500
浅沼組	64,400	682.00	43,920,800
戸田建設	235,800	941.90	222,100,020
熊谷組	28,800	3,600.00	103,680,000
北野建設	700	4,020.00	2,814,000
植木組	1,100	1,574.00	1,731,400
矢作建設工業	23,700	1,534.00	36,355,800
ピーエス・コンストラクション	22,100	1,049.00	23,182,900
日本ハウスホールディングス	37,200	352.00	13,094,400
新日本建設	24,500	1,591.00	38,979,500
東亜道路工業	33,500	1,379.00	46,196,500
日本道路	20,400	1,721.00	35,108,400
東亜建設工業	52,600	980.00	51,548,000
日本国土開発	49,600	500.00	24,800,000
若築建設	6,000	3,435.00	20,610,000
東洋建設	43,900	1,334.00	58,562,600
五洋建設	247,000	639.20	157,882,400
世紀東急工業	22,400	1,533.00	34,339,200
福田組	6,600	5,380.00	35,508,000
住友林業	150,600	7,095.00	1,068,507,000
日本基礎技術	2,300	684.00	1,573,200
巴コーポレーション	4,700	882.00	4,145,400
大和ハウス工業	481,900	4,505.00	2,170,959,500
ライト工業	32,100	2,165.00	69,496,500
積水ハウス	528,500	3,974.00	2,100,259,000
日特建設	16,600	1,026.00	17,031,600
北陸電気工事	11,900	1,207.00	14,363,300
ユアテック	38,400	1,532.00	58,828,800
日本リーテック	13,600	1,090.00	14,824,000
四電工	21,900	1,270.00	27,813,000
中電工	27,000	3,355.00	90,585,000
関電工	109,100	2,226.00	242,856,600
きんでん	121,200	3,150.00	381,780,000
東京エネシス	16,300	1,105.00	18,011,500
トーエネック	29,000	930.00	26,970,000

住友電設	16,600	4,400.00	73,040,000
日本電設工業	32,700	1,919.00	62,751,300
エクシオグループ	170,300	1,555.50	264,901,650
新日本空調	11,300	3,465.00	39,154,500
九電工	37,700	6,763.00	254,965,100
三機工業	37,600	2,399.00	90,202,400
日揮ホールディングス	172,400	1,252.50	215,931,000
中外炉工業	5,700	2,613.00	14,894,100
ヤマト	3,100	971.00	3,010,100
太平電業	11,000	5,180.00	56,980,000
高砂熱学工業	46,700	5,140.00	240,038,000
三晃金属工業	500	4,005.00	2,002,500
朝日工業社	16,300	1,309.00	21,336,700
明星工業	33,700	1,196.00	40,305,200
大気社	20,100	4,895.00	98,389,500
ダイダン	22,900	2,940.00	67,326,000
日比谷総合設備	12,600	3,405.00	42,903,000
フィル・カンパニー	3,400	604.00	2,053,600
テスホールディングス	37,500	294.00	11,025,000
インフロニア・ホールディングス	200,900	1,172.50	235,555,250
東洋エンジニアリング	25,600	726.00	18,585,600
レイズネクスト	25,200	1,653.00	41,655,600
ニッポン	52,400	2,219.00	116,275,600
日清製粉グループ本社	161,800	1,818.50	294,233,300
日東富士製粉	3,100	6,980.00	21,638,000
昭和産業	16,400	2,920.00	47,888,000
鳥越製粉	3,300	680.00	2,244,000
中部飼料	24,200	1,481.00	35,840,200
フィード・ワン	25,600	888.00	22,732,800
東洋精糖	700	1,420.00	994,000
日本甜菜製糖	10,200	2,705.00	27,591,000
D M三井製糖ホールディングス	17,300	3,365.00	58,214,500
塩水港精糖	4,900	280.00	1,372,000
ウェルネオシュガー	8,700	2,199.00	19,131,300
森永製菓	73,200	2,869.50	210,047,400
中村屋	4,400	3,250.00	14,300,000
江崎グリコ	50,000	4,389.00	219,450,000
名糖産業	6,900	1,814.00	12,516,600
井村屋グループ	10,400	2,512.00	26,124,800
不二家	12,000	2,770.00	33,240,000
山崎製パン	117,100	2,845.50	333,208,050
第一屋製パン	800	631.00	504,800

モロゾフ	5,700	4,545.00	25,906,500
亀田製菓	10,000	4,475.00	44,750,000
寿スピリッツ	82,700	1,820.50	150,555,350
カルビー	80,100	3,493.00	279,789,300
森永乳業	61,100	3,513.00	214,644,300
六甲バター	12,800	1,580.00	20,224,000
ヤクルト本社	250,000	3,319.00	829,750,000
明治ホールディングス	214,500	3,590.00	770,055,000
雪印メグミルク	42,300	2,706.00	114,463,800
プリマハム	23,500	2,374.00	55,789,000
日本ハム	75,200	5,333.00	401,041,600
林兼産業	1,300	479.00	622,700
丸大食品	17,600	1,818.00	31,996,800
S Foods	19,300	2,763.00	53,325,900
柿安本店	6,800	2,665.00	18,122,000
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	3,865.00	103,195,500
サッポロホールディングス	57,600	7,909.00	455,558,400
アサヒグループホールディングス	1,313,700	1,878.50	2,467,785,450
キリンホールディングス	728,700	2,186.00	1,592,938,200
シマダヤ	5,700	1,880.00	10,716,000
宝ホールディングス	118,000	1,217.00	143,606,000
オエノンホールディングス	56,600	425.00	24,055,000
養命酒製造	5,800	2,386.00	13,838,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,300	1,994.00	245,860,200
ライフドリンク カンパニー	14,000	1,917.00	26,838,000
サントリー食品インターナショナル	123,200	5,394.00	664,540,800
ダイドーグループホールディングス	19,800	3,030.00	59,994,000
伊藤園	59,100	3,413.00	201,708,300
キーコーヒー	19,600	2,010.00	39,396,000
ユニカフェ	1,200	935.00	1,122,000
日清オイリオグループ	24,600	5,270.00	129,642,000
不二製油グループ本社	40,700	3,171.00	129,059,700
かどや製油	500	3,675.00	1,837,500
J - オイルミルズ	20,000	2,101.00	42,020,000
キッコーマン	579,700	1,628.00	943,751,600
味の素	411,200	5,546.00	2,280,515,200
ブルドックソース	9,300	1,725.00	16,042,500
キューピー	94,000	3,580.00	336,520,000
ハウス食品グループ本社	60,100	3,046.00	183,064,600
カゴメ	75,000	3,208.00	240,600,000
アリアケジャパン	17,400	5,290.00	92,046,000
ピエトロ	500	1,765.00	882,500

エバラ食品工業	4,200	2,801.00	11,764,200
やまみ	500	4,615.00	2,307,500
ニチレイ	80,200	4,467.00	358,253,400
東洋水産	88,400	9,349.00	826,451,600
イトアンドホールディングス	8,300	2,056.00	17,064,800
大冷	500	1,906.00	953,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,811.00	14,488,000
日清食品ホールディングス	184,500	4,007.00	739,291,500
一正蒲鉾	1,600	750.00	1,200,000
フジッコ	18,000	1,719.00	30,942,000
ロック・フィールド	21,400	1,468.00	31,415,200
日本たばこ産業	1,063,100	4,179.00	4,442,694,900
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,236.00	26,832,000
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,324.00	27,190,800
なとり	11,000	2,121.00	23,331,000
イフジ産業	700	1,446.00	1,012,200
ファーマフーズ	23,200	891.00	20,671,200
ユーグレナ	108,700	448.00	48,697,600
紀文食品	15,200	1,156.00	17,571,200
ピクルスホールディングス	10,300	1,032.00	10,629,600
ミヨシ油脂	1,500	1,606.00	2,409,000
理研ビタミン	15,100	2,582.00	38,988,200
片倉工業	16,600	2,061.00	34,212,600
ゲンゼ	12,700	5,630.00	71,501,000
東洋紡	77,300	991.00	76,604,300
ユニチカ	58,900	312.00	18,376,800
富士紡ホールディングス	7,900	4,545.00	35,905,500
倉敷紡績	12,700	4,850.00	61,595,000
シキボウ	12,800	1,066.00	13,644,800
日本毛織	45,900	1,321.00	60,633,900
トーア紡コーポレーション	1,600	397.00	635,200
帝国繊維	20,300	3,075.00	62,422,500
帝人	171,300	1,416.00	242,560,800
東レ	1,192,900	843.20	1,005,853,280
住江織物	800	2,053.00	1,642,400
日本フェルト	2,900	486.00	1,409,400
イチカワ	700	1,650.00	1,155,000
日東製網	400	1,418.00	567,200
アツギ	2,700	764.00	2,062,800
ダイニック	1,200	753.00	903,600
セーレン	34,500	2,702.00	93,219,000
ソトー	1,300	692.00	899,600

東海染工	400	693.00	277,200
小松マテーレ	25,900	765.00	19,813,500
ワコールホールディングス	33,200	4,481.00	148,769,200
ホギメディカル	23,400	4,665.00	109,161,000
T S Iホールディングス	53,400	877.00	46,831,800
マツオカコーポレーション	1,200	1,790.00	2,148,000
ワールド	25,200	1,918.00	48,333,600
三陽商会	8,400	2,380.00	19,992,000
ナイガイ	1,500	234.00	351,000
オンワードホールディングス	105,000	527.00	55,335,000
ルックホールディングス	5,700	2,595.00	14,791,500
ゴールドウイン	31,500	8,278.00	260,757,000
デサント	30,700	4,345.00	133,391,500
キング	1,500	762.00	1,143,000
ヤマトインターナショナル	3,100	320.00	992,000
特種東海製紙	9,500	3,710.00	35,245,000
王子ホールディングス	741,400	574.00	425,563,600
日本製紙	100,400	980.00	98,392,000
三菱製紙	5,200	533.00	2,771,600
北越コーポレーション	87,500	1,568.00	137,200,000
中越パルプ工業	1,500	1,273.00	1,909,500
大王製紙	78,600	906.20	71,227,320
阿波製紙	1,000	446.00	446,000
レンゴー	162,100	998.90	161,921,690
トーモク	10,300	2,355.00	24,256,500
ザ・パック	13,200	3,675.00	48,510,000
北の達人コーポレーション	75,000	166.00	12,450,000
クラレ	259,400	2,119.50	549,798,300
旭化成	1,204,000	1,082.00	1,302,728,000
共和レザー	2,200	654.00	1,438,800
巴川コーポレーション	1,100	743.00	817,300
レゾナック・ホールディングス	159,700	3,680.00	587,696,000
住友化学	1,320,600	407.50	538,144,500
住友精化	8,400	5,150.00	43,260,000
日産化学	83,000	5,126.00	425,458,000
ラサ工業	6,900	2,680.00	18,492,000
クレハ	36,800	2,843.00	104,622,400
多木化学	6,900	3,825.00	26,392,500
テイカ	14,600	1,647.00	24,046,200
石原産業	29,500	1,507.00	44,456,500
片倉コープアグリ	900	981.00	882,900
日本曹達	41,600	2,494.00	103,750,400

東ソー	237,600	1,913.00	454,528,800
トクヤマ	57,500	2,883.50	165,801,250
セントラル硝子	19,000	3,400.00	64,600,000
東亜合成	85,600	1,615.50	138,286,800
大阪ソーダ	62,000	1,919.00	118,978,000
関東電化工業	34,400	948.00	32,611,200
デンカ	64,700	2,252.50	145,736,750
信越化学工業	1,596,000	5,977.00	9,539,292,000
日本カーバイド工業	9,400	1,705.00	16,027,000
堺化学工業	13,600	2,561.00	34,829,600
第一稀元素化学工業	19,500	826.00	16,107,000
エア・ウォーター	167,900	2,011.50	337,730,850
日本酸素ホールディングス	172,700	5,213.00	900,285,100
日本化学工業	6,500	2,865.00	18,622,500
東邦アセチレン	4,000	344.00	1,376,000
日本パーカライズニング	79,300	1,241.00	98,411,300
高压ガス工業	25,800	867.00	22,368,600
チタン工業	500	904.00	452,000
四国化成ホールディングス	20,100	2,057.00	41,345,700
戸田工業	4,100	1,769.00	7,252,900
ステラ ケミファ	9,700	4,125.00	40,012,500
保土谷化学工業	5,600	4,560.00	25,536,000
日本触媒	103,600	1,734.00	179,642,400
大日精化工業	12,400	3,005.00	37,262,000
カネカ	43,900	3,902.00	171,297,800
三菱瓦斯化学	129,900	2,769.50	359,758,050
三井化学	146,800	3,805.00	558,574,000
東京応化工業	84,900	3,489.00	296,216,100
大阪有機化学工業	14,900	3,125.00	46,562,500
三菱ケミカルグループ	1,301,100	918.90	1,195,580,790
KHネオケム	32,100	2,100.00	67,410,000
ダイセル	220,800	1,332.50	294,216,000
住友ベークライト	49,800	4,017.00	200,046,600
積水化学工業	354,400	2,231.50	790,843,600
日本ゼオン	122,000	1,359.50	165,859,000
アイカ工業	44,900	3,397.00	152,525,300
UBE	84,700	2,669.50	226,106,650
積水樹脂	26,600	2,309.00	61,419,400
旭有機材	11,800	4,070.00	48,026,000
ニチバン	9,600	1,910.00	18,336,000
リケンテクノス	33,400	1,035.00	34,569,000
大倉工業	8,200	2,677.00	21,951,400

積水化成成品工業	25,000	392.00	9,800,000
群栄化学工業	4,200	2,704.00	11,356,800
タイガースポリマー	1,700	736.00	1,251,200
ミライアル	1,300	1,463.00	1,901,900
ダイキアクシス	1,600	742.00	1,187,200
ダイキョーニシカワ	39,300	639.00	25,112,700
竹本容器	1,400	846.00	1,184,400
森六ホールディングス	9,200	2,223.00	20,451,600
恵和	11,500	1,080.00	12,420,000
日本化薬	135,900	1,249.00	169,739,100
カーリット	19,200	1,183.00	22,713,600
日本精化	11,800	2,305.00	27,199,000
扶桑化学工業	18,900	3,980.00	75,222,000
トリケミカル研究所	21,600	3,485.00	75,276,000
A D E K A	62,100	2,916.50	181,114,650
日油	161,100	2,460.00	396,306,000
新日本理化	5,300	192.00	1,017,600
ハリマ化成グループ	13,900	843.00	11,717,700
花王	433,400	7,109.00	3,081,040,600
第一工業製薬	7,100	3,220.00	22,862,000
石原ケミカル	8,000	2,472.00	19,776,000
日華化学	1,500	1,222.00	1,833,000
ニイタカ	800	1,917.00	1,533,600
三洋化成工業	10,900	4,145.00	45,180,500
有機合成薬品工業	3,100	267.00	827,700
大日本塗料	19,700	1,090.00	21,473,000
日本ペイントホールディングス	787,500	1,097.50	864,281,250
関西ペイント	153,800	2,552.00	392,497,600
神東塗料	3,200	133.00	425,600
中国塗料	36,500	2,038.00	74,387,000
日本特殊塗料	2,700	1,174.00	3,169,800
藤倉化成	20,500	466.00	9,553,000
太陽ホールディングス	31,000	3,700.00	114,700,000
D I C	63,200	3,243.00	204,957,600
サカタインクス	39,600	1,611.00	63,795,600
a r t i e n c e	31,900	3,870.00	123,453,000
富士フイルムホールディングス	991,700	3,688.00	3,657,389,600
資生堂	372,100	3,875.00	1,441,887,500
ライオン	226,800	1,615.00	366,282,000
高砂香料工業	13,400	5,510.00	73,834,000
マンダム	38,500	1,239.00	47,701,500
ミルボン	28,600	3,168.00	90,604,800

コーセー	36,200	9,284.00	336,080,800
コタ	18,100	1,649.00	29,846,900
シーボン	500	1,282.00	641,000
ポーラ・オルビスホールディングス	91,300	1,479.00	135,032,700
ノエビアホールディングス	15,900	5,170.00	82,203,000
アジュバンホールディングス	900	822.00	739,800
新日本製薬	10,200	1,710.00	17,442,000
I - n e	5,900	1,819.00	10,732,100
アクシージア	11,700	638.00	7,464,600
エステー	13,800	1,478.00	20,396,400
アグロ カネショウ	6,200	1,278.00	7,923,600
コニシ	51,500	1,208.00	62,212,000
長谷川香料	34,100	3,275.00	111,677,500
小林製薬	46,700	5,703.00	266,330,100
荒川化学工業	15,100	1,224.00	18,482,400
メック	14,700	3,680.00	54,096,000
日本高純度化学	4,000	3,155.00	12,620,000
タカラバイオ	48,000	1,006.00	48,288,000
J C U	19,700	3,485.00	68,654,500
新田ゼラチン	2,600	871.00	2,264,600
O A T アグリオ	7,400	2,074.00	15,347,600
デクセリアルズ	132,000	2,025.50	267,366,000
アース製薬	16,200	5,330.00	86,346,000
北興化学工業	15,900	1,320.00	20,988,000
大成ラミック	5,200	2,632.00	13,686,400
クミアイ化学工業	70,800	842.00	59,613,600
日本農薬	32,700	605.00	19,783,500
アキレス	11,200	1,485.00	16,632,000
有沢製作所	31,200	1,422.00	44,366,400
日東電工	563,500	2,388.50	1,345,919,750
レック	22,800	1,312.00	29,913,600
三光合成	22,400	569.00	12,745,600
きもと	6,300	233.00	1,467,900
藤森工業	14,100	4,405.00	62,110,500
前澤化成工業	11,500	1,768.00	20,332,000
未来工業	6,400	3,515.00	22,496,000
ウェーブロックホールディングス	1,400	610.00	854,000
J S P	12,500	1,938.00	24,225,000
エフピコ	33,700	2,863.50	96,499,950
天馬	11,900	2,604.00	30,987,600
信越ポリマー	38,400	1,550.00	59,520,000
東リ	8,500	382.00	3,247,000

ニフコ	53,300	3,636.00	193,798,800
バルカー	14,900	3,295.00	49,095,500
ユニ・チャーム	371,200	5,183.00	1,923,929,600
ショーエイコーポレーション	1,200	575.00	690,000
協和キリン	215,300	2,527.00	544,063,100
武田薬品工業	1,577,100	4,103.00	6,470,841,300
アステラス製薬	1,563,100	1,647.00	2,574,425,700
住友ファーマ	132,200	596.00	78,791,200
塩野義製薬	650,100	2,053.50	1,334,980,350
わかもと製薬	4,000	265.00	1,060,000
日本新薬	46,700	3,726.00	174,004,200
中外製薬	557,800	6,932.00	3,866,669,600
科研製薬	30,500	3,823.00	116,601,500
エーザイ	216,700	5,345.00	1,158,261,500
ロート製薬	172,600	3,572.00	616,527,200
小野薬品工業	364,500	1,911.50	696,741,750
久光製薬	39,600	3,863.00	152,974,800
持田製薬	19,900	3,355.00	66,764,500
参天製薬	314,400	1,734.50	545,326,800
扶桑薬品工業	6,300	2,247.00	14,156,100
日本ケミファ	400	1,579.00	631,600
ツムラ	56,100	4,512.00	253,123,200
キッセイ薬品工業	29,500	3,545.00	104,577,500
生化学工業	30,200	850.00	25,670,000
栄研化学	30,700	2,324.00	71,346,800
鳥居薬品	9,600	3,875.00	37,200,000
JCRファーマ	60,300	657.00	39,617,100
東和薬品	27,400	3,010.00	82,474,000
富士製薬工業	13,200	1,273.00	16,803,600
ゼリア新薬工業	24,700	2,270.00	56,069,000
ネクセラファーマ	83,600	1,232.00	102,995,200
第一三共	1,552,400	4,709.00	7,310,251,600
杏林製薬	38,600	1,520.00	58,672,000
大幸薬品	40,400	392.00	15,836,800
ダイト	13,500	2,249.00	30,361,500
大塚ホールディングス	444,800	8,083.00	3,595,318,400
ペプチドリーム	86,400	2,661.00	229,910,400
セルソース	11,800	1,250.00	14,750,000
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,218.00	40,589,400
サワイグループホールディングス	122,400	2,037.50	249,390,000
日本コークス工業	180,800	99.00	17,899,200
ニチレキ	23,200	2,502.00	58,046,400

ユシロ化学工業	9,200	1,562.00	14,370,400
ビーピー・カストロール	1,800	880.00	1,584,000
富士石油	51,900	353.00	18,320,700
MORESCO	1,400	1,218.00	1,705,200
出光興産	925,300	1,028.00	951,208,400
ENEOSホールディングス	2,821,100	778.70	2,196,790,570
コスモエネルギーホールディングス	52,800	7,814.00	412,579,200
横浜ゴム	90,100	3,212.00	289,401,200
TOYO TIRE	102,400	2,087.00	213,708,800
ブリヂストン	521,600	5,500.00	2,868,800,000
住友ゴム工業	174,800	1,567.50	273,999,000
藤倉コンポジット	17,100	1,185.00	20,263,500
オカモト	8,300	5,230.00	43,409,000
フコク	9,400	1,765.00	16,591,000
ニッタ	18,100	3,690.00	66,789,000
住友理工	27,700	1,457.00	40,358,900
三ツ星ベルト	20,700	3,975.00	82,282,500
バンドー化学	26,400	1,769.00	46,701,600
日東紡績	22,600	5,890.00	133,114,000
A G C	173,400	4,647.00	805,789,800
日本板硝子	85,000	373.00	31,705,000
石塚硝子	700	2,380.00	1,666,000
日本山村硝子	1,400	1,515.00	2,121,000
日本電気硝子	66,100	3,362.00	222,228,200
オハラ	8,500	1,437.00	12,214,500
住友大阪セメント	29,700	4,086.00	121,354,200
太平洋セメント	102,100	3,369.00	343,974,900
日本ヒューム	15,600	1,332.00	20,779,200
日本コンクリート工業	34,600	341.00	11,798,600
三谷セキサン	7,500	5,680.00	42,600,000
アジアパイルホールディングス	25,300	829.00	20,973,700
東海カーボン	164,400	921.00	151,412,400
日本カーボン	10,200	4,515.00	46,053,000
東洋炭素	12,600	5,690.00	71,694,000
ノリタケ	19,700	3,905.00	76,928,500
TOTO	117,600	5,337.00	627,631,200
日本碍子	207,300	1,871.00	387,858,300
日本特殊陶業	145,600	3,995.00	581,672,000
MARUWA	6,600	41,950.00	276,870,000
品川リフラクトリーズ	21,900	1,699.00	37,208,100
黒崎播磨	14,500	2,227.00	32,291,500
ヨータイ	10,400	1,699.00	17,669,600

東京窯業	4,100	403.00	1,652,300
ニッカトー	1,700	544.00	924,800
フジインコーポレーテッド	47,900	2,370.00	113,523,000
クニミネ工業	1,100	1,070.00	1,177,000
エーアンドエーマテリアル	800	1,177.00	941,600
ニチアス	45,100	5,690.00	256,619,000
ニチハ	22,300	3,475.00	77,492,500
日本製鉄	869,300	3,198.00	2,780,021,400
神戸製鋼所	368,700	1,711.50	631,030,050
中山製鋼所	41,900	776.00	32,514,400
合同製鐵	10,300	4,125.00	42,487,500
J F E ホールディングス	509,800	1,918.50	978,051,300
東京製鐵	51,500	1,984.00	102,176,000
共英製鋼	20,900	1,730.00	36,157,000
大和工業	34,600	7,157.00	247,632,200
東京鐵鋼	8,100	5,150.00	41,715,000
大阪製鐵	8,400	3,425.00	28,770,000
淀川製鋼所	19,000	5,590.00	106,210,000
中部鋼鈹	12,000	2,511.00	30,132,000
丸一鋼管	55,800	3,363.00	187,655,400
モリ工業	4,600	5,180.00	23,828,000
大同特殊鋼	115,500	1,404.50	162,219,750
日本高周波鋼業	1,600	391.00	625,600
日本冶金工業	13,400	4,530.00	60,702,000
山陽特殊製鋼	18,100	1,914.00	34,643,400
愛知製鋼	10,600	3,925.00	41,605,000
日本金属	1,000	677.00	677,000
大平洋金属	15,600	1,378.00	21,496,800
新日本電工	109,500	306.00	33,507,000
栗本鐵工所	8,500	4,095.00	34,807,500
虹技	500	1,068.00	534,000
三菱製鋼	13,600	1,356.00	18,441,600
日亜鋼業	4,100	302.00	1,238,200
日本精線	14,600	1,229.00	17,943,400
エンビプロ・ホールディングス	18,100	498.00	9,013,800
シンニッタン	5,000	212.00	1,060,000
新家工業	900	4,760.00	4,284,000
大紀アルミニウム工業所	23,700	1,080.00	25,596,000
日本輕金属ホールディングス	53,900	1,628.00	87,749,200
三井金属鈹業	53,500	4,880.00	261,080,000
三菱マテリアル	131,300	2,575.00	338,097,500
住友金属鈹山	212,700	4,291.00	912,695,700

DOWAホールディングス	45,400	5,255.00	238,577,000
古河機械金属	24,500	1,614.00	39,543,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,000	2,484.00	79,488,000
東邦チタニウム	38,400	1,132.00	43,468,800
UACJ	25,800	5,120.00	132,096,000
CKサンエツ	4,600	3,450.00	15,870,000
古河電気工業	61,200	3,608.00	220,809,600
住友電気工業	686,000	2,295.50	1,574,713,000
フジクラ	216,400	4,818.00	1,042,615,200
SWCC	20,600	5,730.00	118,038,000
カナレ電気	1,000	1,451.00	1,451,000
平河ビューテック	12,100	1,485.00	17,968,500
リョービ	19,800	1,947.00	38,550,600
アーレスティ	4,900	573.00	2,807,700
AREホールディングス	69,100	1,815.00	125,416,500
稲葉製作所	10,200	1,737.00	17,717,400
宮地エンジニアリンググループ	18,400	2,079.00	38,253,600
トーカロ	52,900	1,916.00	101,356,400
アルファCO	1,400	1,183.00	1,656,200
SUMCO	349,000	1,542.00	538,158,000
川田テクノロジーズ	13,000	2,541.00	33,033,000
RS Technologies	14,000	3,600.00	50,400,000
ジェイテックコーポレーション	700	1,640.00	1,148,000
信和	2,500	744.00	1,860,000
東洋製罐グループホールディングス	105,200	2,251.00	236,805,200
ホッカンホールディングス	8,900	1,723.00	15,334,700
コロナ	10,200	936.00	9,547,200
横河ブリッジホールディングス	28,700	2,659.00	76,313,300
駒井ハルテック	700	1,672.00	1,170,400
高田機工	900	1,158.00	1,042,200
三和ホールディングス	182,600	3,775.00	689,315,000
文化シャッター	48,000	1,805.00	86,640,000
三協立山	23,100	747.00	17,255,700
アルインコ	14,000	979.00	13,706,000
東洋シャッター	900	795.00	715,500
LIXIL	286,300	1,713.50	490,575,050
日本フィルコン	2,600	525.00	1,365,000
ノーリツ	25,800	1,822.00	47,007,600
長府製作所	20,500	1,967.00	40,323,500
リンナイ	87,700	3,531.00	309,668,700
ダイニチ工業	2,000	632.00	1,264,000
日東精工	26,600	569.00	15,135,400

三洋工業	500	3,025.00	1,512,500
岡部	32,700	792.00	25,898,400
ジーテクト	23,400	1,570.00	36,738,000
東ブレ	32,300	1,789.00	57,784,700
高周波熱錬	27,100	987.00	26,747,700
東京製綱	11,900	1,084.00	12,899,600
サンコール	20,400	381.00	7,772,400
モリテック スチール	3,500	186.00	651,000
パイオラックス	22,200	2,337.00	51,881,400
エイチワン	18,900	936.00	17,690,400
日本発條	162,200	1,818.00	294,879,600
中央発條	13,600	1,168.00	15,884,800
アドバネクス	500	895.00	447,500
立川ブラインド工業	8,300	1,290.00	10,707,000
日本ドライケミカル	900	3,405.00	3,064,500
日本製鋼所	49,400	5,024.00	248,185,600
三浦工業	74,900	3,512.00	263,048,800
タクマ	60,700	1,603.00	97,302,100
ツガミ	38,300	1,482.00	56,760,600
オークマ	31,400	3,063.00	96,178,200
芝浦機械	16,900	3,950.00	66,755,000
アマダ	272,000	1,457.50	396,440,000
アイダエンジニアリング	41,500	767.00	31,830,500
F U J I	84,500	2,281.00	192,744,500
牧野フライス製作所	19,900	5,870.00	116,813,000
オーエスジー	79,100	2,024.50	160,137,950
ダイジェット工業	400	760.00	304,000
旭ダイヤモンド工業	41,400	860.00	35,604,000
D M G 森精機	113,200	3,016.00	341,411,200
ソディック	47,400	798.00	37,825,200
ディスコ	86,400	37,490.00	3,239,136,000
日東工器	8,300	2,459.00	20,409,700
日進工具	16,700	751.00	12,541,700
パンチ工業	3,900	419.00	1,634,100
富士ダイス	13,300	776.00	10,320,800
豊和工業	2,100	870.00	1,827,000
リケンNPR	19,500	2,296.00	44,772,000
東洋機械金属	3,200	628.00	2,009,600
エンシュウ	1,000	622.00	622,000
島精機製作所	28,600	1,140.00	32,604,000
オプトラン	29,500	1,778.00	52,451,000
イワキポンプ	12,000	2,882.00	34,584,000

フリー	16,900	1,057.00	17,863,300
ヤマシンフィルタ	42,700	513.00	21,905,100
日阪製作所	19,600	1,051.00	20,599,600
やまびこ	29,300	2,541.00	74,451,300
野村マイクロ・サイエンス	24,300	2,426.00	58,951,800
平田機工	8,600	4,870.00	41,882,000
P E G A S U S	19,800	493.00	9,761,400
マルマエ	7,800	1,546.00	12,058,800
タツモ	12,800	2,935.00	37,568,000
ナブテスコ	112,600	2,469.00	278,009,400
三井海洋開発	22,700	3,385.00	76,839,500
レオン自動機	20,800	1,356.00	28,204,800
S M C	53,700	63,650.00	3,418,005,000
ホソカワミクロン	12,500	4,100.00	51,250,000
ユニオンツール	7,900	6,150.00	48,585,000
瑞光	12,900	1,248.00	16,099,200
オイレス工業	24,300	2,036.00	49,474,800
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,780.00	29,158,000
サトーホールディングス	24,600	2,095.00	51,537,000
技研製作所	16,900	1,812.00	30,622,800
日本エアーテック	8,400	1,169.00	9,819,600
カワタ	1,200	831.00	997,200
日精樹脂工業	13,400	921.00	12,341,400
オカダアイヨン	1,300	2,087.00	2,713,100
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,171.00	18,236,400
小松製作所	841,100	3,966.00	3,335,802,600
住友重機械工業	106,200	3,440.00	365,328,000
日立建機	71,500	3,471.00	248,176,500
日工	26,600	689.00	18,327,400
巴工業	7,000	4,305.00	30,135,000
井関農機	16,800	995.00	16,716,000
T O W A	60,000	2,197.00	131,820,000
丸山製作所	700	2,410.00	1,687,000
北川鉄工所	7,100	1,210.00	8,591,000
ローツェ	93,800	1,970.00	184,786,000
タカキタ	1,300	430.00	559,000
クボタ	938,200	2,031.00	1,905,484,200
荏原実業	8,600	4,070.00	35,002,000
三菱化工機	6,300	3,535.00	22,270,500
月島ホールディングス	24,300	1,287.00	31,274,100
帝国電機製作所	12,300	2,713.00	33,369,900
新東工業	36,300	964.00	34,993,200

澁谷工業	16,800	3,800.00	63,840,000
アイチ コーポレーション	24,800	1,174.00	29,115,200
小森コーポレーション	44,200	1,126.00	49,769,200
鶴見製作所	13,700	4,040.00	55,348,000
日本ギア工業	1,500	468.00	702,000
酒井重工業	7,000	2,420.00	16,940,000
荏原製作所	368,400	2,327.50	857,451,000
西島製作所	15,500	2,720.00	42,160,000
北越工業	18,100	1,866.00	33,774,600
ダイキン工業	214,200	20,075.00	4,300,065,000
オルガノ	21,600	7,000.00	151,200,000
トーヨーカネツ	6,100	4,005.00	24,430,500
栗田工業	100,400	6,166.00	619,066,400
椿本チエイン	73,800	1,879.00	138,670,200
大同工業	1,700	845.00	1,436,500
木村化工機	13,700	706.00	9,672,200
アネスト岩田	27,800	1,331.00	37,001,800
ダイフク	302,900	2,761.50	836,458,350
サムコ	4,300	3,355.00	14,426,500
加藤製作所	2,000	1,180.00	2,360,000
油研工業	700	2,175.00	1,522,500
タダノ	103,300	955.40	98,692,820
フジテック	41,900	4,966.00	208,075,400
C K D	49,600	2,945.00	146,072,000
平和	53,100	2,122.00	112,678,200
理想科学工業	14,400	3,415.00	49,176,000
S A N K Y O	172,800	2,106.00	363,916,800
日本金銭機械	21,700	917.00	19,898,900
マースグループホールディングス	9,100	3,295.00	29,984,500
フクシマガリレイ	11,700	5,470.00	63,999,000
オーイズミ	1,500	359.00	538,500
ダイコク電機	8,800	3,330.00	29,304,000
竹内製作所	32,600	4,420.00	144,092,000
アマノ	50,900	4,306.00	219,175,400
J U K I	27,900	400.00	11,160,000
ジャノメ	18,200	826.00	15,033,200
マックス	25,300	3,600.00	91,080,000
グローリー	43,100	2,558.00	110,249,800
新晃工業	18,100	4,690.00	84,889,000
大和冷機工業	27,500	1,468.00	40,370,000
セガサミーホールディングス	160,300	2,860.00	458,458,000
T P R	22,800	2,199.00	50,137,200

ツバキ・ナカシマ	44,300	703.00	31,142,900
ホシザキ	115,500	4,984.00	575,652,000
大豊工業	15,500	612.00	9,486,000
日本精工	332,200	720.90	239,482,980
N T N	389,300	256.30	99,777,590
ジェイテクト	159,700	1,021.50	163,133,550
不二越	13,300	3,115.00	41,429,500
日本トムソン	48,900	471.00	23,031,900
T H K	103,500	2,514.00	260,199,000
ユーシン精機	14,200	646.00	9,173,200
前澤給装工業	12,900	1,270.00	16,383,000
イーグル工業	19,800	2,047.00	40,530,600
前澤工業	2,400	1,265.00	3,036,000
P I L L A R	16,600	4,150.00	68,890,000
キッツ	60,100	1,041.00	62,564,100
マキタ	204,700	4,841.00	990,952,700
三井E & S	89,100	1,131.00	100,772,100
日立造船	158,400	991.00	156,974,400
三菱重工業	3,138,200	2,117.50	6,645,138,500
I H I	133,600	7,443.00	994,384,800
スター精密	30,300	1,923.00	58,266,900
日清紡ホールディングス	134,900	958.80	129,342,120
イビデン	93,600	4,425.00	414,180,000
コニカミノルタ	401,300	413.20	165,817,160
ブラザー工業	239,800	2,780.00	666,644,000
ミネベアミツミ	312,200	2,818.00	879,779,600
日立製作所	4,312,300	3,781.00	16,304,806,300
三菱電機	1,965,700	2,303.50	4,527,989,950
富士電機	109,100	8,620.00	940,442,000
東洋電機製造	1,400	1,153.00	1,614,200
安川電機	194,900	4,998.00	974,110,200
シンフォニアテクノロジー	19,800	5,050.00	99,990,000
明電舎	33,300	3,345.00	111,388,500
オリジン	900	1,194.00	1,074,600
山洋電気	7,800	9,630.00	75,114,000
デンヨー	13,700	2,574.00	35,263,800
P H C ホールディングス	33,800	1,054.00	35,625,200
K O K U S A I E L E C T R I C	93,900	3,180.00	298,602,000
ソシオネクスト	131,000	2,836.00	371,516,000
東芝テック	23,000	3,470.00	79,810,000
芝浦メカトロニクス	10,200	7,840.00	79,968,000
マブチモーター	78,900	2,224.00	175,473,600

ニデック	792,400	3,006.00	2,381,954,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,900	383.00	4,557,700
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,551.00	14,579,400
東光高岳	10,900	1,798.00	19,598,200
ダブル・スコープ	51,400	363.00	18,658,200
ダイヘン	17,000	6,520.00	110,840,000
ヤーマン	35,200	850.00	29,920,000
JVCケンウッド	141,800	1,345.00	190,721,000
ミマキエンジニアリング	17,200	1,365.00	23,478,000
IPEX	10,100	1,569.00	15,846,900
大崎電気工業	38,500	738.00	28,413,000
オムロン	137,000	6,547.00	896,939,000
日東工業	24,200	3,010.00	72,842,000
IDEC	26,500	2,551.00	67,601,500
正興電機製作所	1,400	1,289.00	1,804,600
不二電機工業	900	1,065.00	958,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	70,100	2,847.50	199,609,750
サクサ	900	2,351.00	2,115,900
メルコホールディングス	5,700	2,292.00	13,064,400
テクノメディカ	4,500	1,831.00	8,239,500
日本電気	235,700	13,750.00	3,240,875,000
富士通	1,651,300	2,935.50	4,847,391,150
沖電気工業	81,100	974.00	78,991,400
電気興業	7,200	1,930.00	13,896,000
サンケン電気	16,700	6,706.00	111,990,200
ナカヨ	600	1,166.00	699,600
アイホン	9,700	2,818.00	27,334,600
ルネサスエレクトロニクス	1,367,300	2,079.00	2,842,616,700
セイコーエプソン	230,200	2,639.50	607,612,900
ワコム	126,500	683.00	86,399,500
アルバック	39,400	7,619.00	300,188,600
アクセル	9,100	1,328.00	12,084,800
EIZO	26,200	2,177.00	57,037,400
日本信号	40,900	956.00	39,100,400
京三製作所	37,600	504.00	18,950,400
能美防災	24,300	2,916.00	70,858,800
ホーチキ	13,500	2,121.00	28,633,500
星和電機	2,000	542.00	1,084,000
エレコム	43,100	1,451.00	62,538,100
パナソニック ホールディングス	2,120,000	1,243.00	2,635,160,000
シャープ	302,500	949.80	287,314,500
アンリツ	126,400	1,087.00	137,396,800

富士通ゼネラル	50,900	2,110.00	107,399,000
ソニーグループ	6,221,000	2,777.50	17,278,827,500
T D K	1,421,000	1,823.00	2,590,483,000
帝国通信工業	8,000	2,379.00	19,032,000
タムラ製作所	71,500	609.00	43,543,500
アルプスアルパイン	160,400	1,544.00	247,657,600
池上通信機	1,200	677.00	812,400
日本電波工業	21,700	1,073.00	23,284,100
鈴木	9,700	1,635.00	15,859,500
メイコー	17,900	6,170.00	110,443,000
日本トリム	4,100	3,600.00	14,760,000
フォスター電機	13,300	1,814.00	24,126,200
S M K	4,800	2,290.00	10,992,000
ヨコオ	16,000	1,490.00	23,840,000
ホシデン	40,900	2,090.00	85,481,000
ヒロセ電機	26,100	18,210.00	475,281,000
日本航空電子工業	42,900	2,543.00	109,094,700
T O A	20,400	972.00	19,828,800
マクセル	39,800	1,839.00	73,192,200
古野電気	23,500	1,620.00	38,070,000
スミダコーポレーション	24,400	916.00	22,350,400
アイコム	6,900	2,796.00	19,292,400
リオン	7,500	2,123.00	15,922,500
横河電機	196,300	3,655.00	717,476,500
新電元工業	6,900	2,345.00	16,180,500
アズビル	488,800	1,160.50	567,252,400
東亜ディーケーケー	2,000	829.00	1,658,000
日本光電工業	152,100	2,127.00	323,516,700
チノー	7,400	2,290.00	16,946,000
共和電業	3,900	421.00	1,641,900
日本電子材料	10,900	2,499.00	27,239,100
堀場製作所	33,700	9,344.00	314,892,800
アドバンテスト	509,000	6,741.00	3,431,169,000
小野測器	2,100	581.00	1,220,100
エスベック	14,300	2,566.00	36,693,800
キーエンス	177,800	68,360.00	12,154,408,000
日置電機	9,300	8,220.00	76,446,000
シスメックス	460,100	2,827.00	1,300,702,700
日本マイクロニクス	29,300	3,935.00	115,295,500
メガチップス	13,800	5,200.00	71,760,000
O B A R A G R O U P	11,200	4,040.00	45,248,000
澤藤電機	600	1,080.00	648,000

原田工業	2,000	549.00	1,098,000
コーセル	19,200	1,173.00	22,521,600
イリソ電子工業	16,400	2,551.00	41,836,400
オブテックスグループ	32,700	1,551.00	50,717,700
千代田インテグレ	6,200	3,375.00	20,925,000
レーザーテック	81,500	23,605.00	1,923,807,500
スタンレー電気	113,800	2,663.50	303,106,300
ウシオ電機	78,700	2,030.00	159,761,000
岡谷電機産業	3,700	235.00	869,500
ハリオス テクノ ホールディング	4,100	941.00	3,858,100
エノモト	1,200	1,385.00	1,662,000
日本セラミック	16,400	2,529.00	41,475,600
遠藤照明	1,800	1,328.00	2,390,400
古河電池	13,200	1,377.00	18,176,400
山一電機	16,100	2,514.00	40,475,400
図研	14,900	3,590.00	53,491,000
日本電子	44,600	5,559.00	247,931,400
カシオ計算機	128,400	1,188.50	152,603,400
ファナック	859,800	4,190.00	3,602,562,000
日本シイエムケイ	42,300	407.00	17,216,100
エンプラス	5,200	6,500.00	33,800,000
大真空	26,900	593.00	15,951,700
ローム	322,100	1,606.00	517,292,600
浜松ホトニクス	285,400	1,875.50	535,267,700
三井ハイテック	78,900	900.60	71,057,340
新光電気工業	62,900	5,489.00	345,258,100
京セラ	1,104,100	1,660.00	1,832,806,000
太陽誘電	86,600	2,915.50	252,482,300
村田製作所	1,587,200	2,806.50	4,454,476,800
双葉電子工業	34,300	498.00	17,081,400
北陸電気工業	1,600	1,323.00	2,116,800
ニチコン	46,900	952.00	44,648,800
日本ケミコン	19,100	1,045.00	19,959,500
K O A	27,100	1,133.00	30,704,300
市光工業	32,600	447.00	14,572,200
小糸製作所	184,200	1,975.00	363,795,000
ミツバ	33,300	898.00	29,903,400
S C R E E Nホールディングス	60,700	9,973.00	605,361,100
キャノン電子	16,900	2,291.00	38,717,900
キャノン	886,200	4,703.00	4,167,798,600
リコー	445,500	1,542.50	687,183,750
象印マホービン	53,200	1,653.00	87,939,600

MUTOHホールディングス	600	2,378.00	1,426,800	
東京エレクトロン	376,000	25,290.00	9,509,040,000	
イノテック	12,000	1,406.00	16,872,000	
トヨタ紡織	74,800	1,868.00	139,726,400	
芦森工業	800	2,272.00	1,817,600	
ユニプレス	31,900	1,117.00	35,632,300	
豊田自動織機	151,500	11,025.00	1,670,287,500	
モリタホールディングス	31,200	2,203.00	68,733,600	
三櫻工業	27,200	738.00	20,073,600	
デンソー	1,465,900	2,125.50	3,115,770,450	
東海理化電機製作所	50,100	1,960.00	98,196,000	
川崎重工業	145,000	5,805.00	841,725,000	
名村造船所	55,300	1,395.00	77,143,500	
日本車輛製造	5,900	2,153.00	12,702,700	
三菱ロジスネクスト	28,400	1,299.00	36,891,600	
近畿車輛	500	1,439.00	719,500	
日産自動車	2,337,800	402.50	940,964,500	
いすゞ自動車	498,900	1,931.00	963,375,900	
トヨタ自動車	9,445,100	2,542.50	24,014,166,750	
日野自動車	267,200	463.10	123,740,320	
三菱自動車工業	693,100	384.50	266,496,950	
エフテック	2,700	514.00	1,387,800	
レシップホールディングス	1,800	558.00	1,004,400	
GMB	800	1,165.00	932,000	
ファルテック	800	462.00	369,600	
武蔵精密工業	43,400	1,954.00	84,803,600	
日産車体	18,000	1,039.00	18,702,000	
新明和工業	51,200	1,324.00	67,788,800	
極東開発工業	29,300	2,524.00	73,953,200	
トピー工業	14,400	1,975.00	28,440,000	
ティラド	3,900	3,410.00	13,299,000	
曙ブレーキ工業	108,400	128.00	13,875,200	
タチエス	32,800	1,824.00	59,827,200	
NOK	69,000	2,244.00	154,836,000	
フタバ産業	47,700	690.00	32,913,000	
カヤバ	16,800	4,815.00	80,892,000	
大同メタル工業	34,800	483.00	16,808,400	
プレス工業	71,000	576.00	40,896,000	
ミクニ	4,900	339.00	1,661,100	
太平洋工業	40,800	1,371.00	55,936,800	
アイシン	376,200	1,577.00	593,267,400	
マツダ	587,700	1,070.00	628,839,000	

今仙電機製作所	2,500	554.00	1,385,000
本田技研工業	4,209,800	1,507.50	6,346,273,500
スズキ	1,305,300	1,592.50	2,078,690,250
S U B A R U	551,000	2,482.00	1,367,582,000
安永	1,700	577.00	980,900
ヤマハ発動機	749,900	1,280.00	959,872,000
T B K	4,300	288.00	1,238,400
エクセディ	29,100	3,195.00	92,974,500
豊田合成	50,900	2,445.00	124,450,500
愛三工業	29,500	1,396.00	41,182,000
盟和産業	600	1,170.00	702,000
日本プラスト	3,300	365.00	1,204,500
ヨロズ	16,700	1,078.00	18,002,600
エフ・シー・シー	31,400	2,380.00	74,732,000
シマノ	77,600	27,170.00	2,108,392,000
テイ・エス テック	63,300	1,743.50	110,363,550
ジャムコ	10,700	1,328.00	14,209,600
テルモ	990,500	2,700.00	2,674,350,000
クリエートメディック	1,200	957.00	1,148,400
日機装	46,000	1,012.00	46,552,000
日本エム・ディ・エム	14,100	719.00	10,137,900
島津製作所	236,100	4,774.00	1,127,141,400
J M S	16,400	497.00	8,150,800
長野計器	12,900	2,494.00	32,172,600
ブイ・テクノロジー	9,400	2,490.00	23,406,000
東京計器	13,600	3,205.00	43,588,000
愛知時計電機	7,700	2,019.00	15,546,300
インターアクション	10,700	1,208.00	12,925,600
オーバル	3,400	379.00	1,288,600
東京精密	36,400	7,550.00	274,820,000
マニー	71,100	1,821.00	129,473,100
ニコン	256,900	1,485.50	381,624,950
トプコン	86,400	1,545.50	133,531,200
オリンパス	1,017,200	2,718.50	2,765,258,200
理研計器	25,200	3,840.00	96,768,000
タムロン	24,500	4,470.00	109,515,000
H O Y A	349,800	19,785.00	6,920,793,000
シード	2,300	508.00	1,168,400
ノーリツ鋼機	16,800	4,370.00	73,416,000
A & D ホロンホールディングス	25,900	2,111.00	54,674,900
朝日インテック	216,600	2,521.00	546,048,600
シチズン時計	163,500	911.00	148,948,500

リズム	900	4,090.00	3,681,000	
大研医器	3,300	523.00	1,725,900	
メニコン	61,100	1,459.00	89,144,900	
シンシア	400	434.00	173,600	
松風	16,000	2,322.00	37,152,000	
セイコーグループ	24,800	3,890.00	96,472,000	
ニプロ	148,100	1,423.50	210,820,350	
KYORITSU	5,700	152.00	866,400	
中本パックス	1,300	1,598.00	2,077,400	
パラマウントベッドホールディングス	36,900	2,590.00	95,571,000	
トランザクション	11,700	2,330.00	27,261,000	
粧美堂	1,000	538.00	538,000	
ニホンフラッシュ	16,700	902.00	15,063,400	
前田工織	31,700	1,875.00	59,437,500	
永大産業	4,500	225.00	1,012,500	
アートネイチャー	16,000	820.00	13,120,000	
フルヤ金属	16,900	4,015.00	67,853,500	
バンダイナムコホールディングス	482,400	3,276.00	1,580,342,400	
アイフィスジャパン	1,100	568.00	624,800	
SHOEI	50,000	2,233.00	111,650,000	
フランスベッドホールディングス	23,000	1,217.00	27,991,000	
パイロットコーポレーション	27,800	4,435.00	123,293,000	
萩原工業	11,900	1,541.00	18,337,900	
フジシールインターナショナル	36,000	2,526.00	90,936,000	
タカラトミー	80,900	3,912.00	316,480,800	
広済堂ホールディングス	57,500	510.00	29,325,000	
エステールホールディングス	900	625.00	562,500	
タカノ	1,400	772.00	1,080,800	
プロネクサス	18,400	1,245.00	22,908,000	
ホクシン	2,900	106.00	307,400	
ウッドワン	1,400	800.00	1,120,000	
TOPPANホールディングス	211,800	4,244.00	898,879,200	
大日本印刷	368,400	2,552.00	940,156,800	
共同印刷	5,000	3,310.00	16,550,000	
NISSHA	30,400	1,942.00	59,036,800	
光村印刷	300	1,533.00	459,900	
TAKARA & COMPANY	10,500	2,790.00	29,295,000	
アシックス	656,000	3,001.00	1,968,656,000	
ツツミ	4,200	2,119.00	8,899,800	
ローランド	13,100	3,745.00	49,059,500	
小松ウオール工業	14,400	1,520.00	21,888,000	
ヤマハ	324,600	1,233.50	400,394,100	

河合楽器製作所	5,400	2,859.00	15,438,600
クリナップ	17,400	700.00	12,180,000
ピジョン	113,200	1,682.00	190,402,400
キングジム	15,700	836.00	13,125,200
リンテック	35,700	3,305.00	117,988,500
イトーキ	35,500	1,490.00	52,895,000
任天堂	1,121,700	7,636.00	8,565,301,200
三菱鉛筆	24,600	2,409.00	59,261,400
タカラスタンダード	36,300	1,596.00	57,934,800
コクヨ	88,800	2,531.00	224,752,800
ナカバヤシ	19,100	520.00	9,932,000
グローブライド	15,900	1,846.00	29,351,400
オカムラ	53,500	1,977.00	105,769,500
美津濃	17,700	9,100.00	161,070,000
東京電力ホールディングス	1,601,600	636.90	1,020,059,040
中部電力	654,700	1,681.00	1,100,550,700
関西電力	686,100	2,370.00	1,626,057,000
中国電力	308,700	977.00	301,599,900
北陸電力	181,700	924.80	168,036,160
東北電力	467,800	1,371.00	641,353,800
四国電力	165,500	1,272.50	210,598,750
九州電力	409,600	1,562.50	640,000,000
北海道電力	171,700	965.30	165,742,010
沖縄電力	45,400	1,039.00	47,170,600
電源開発	145,900	2,395.00	349,430,500
エフオン	12,900	379.00	4,889,100
イーレックス	31,600	721.00	22,783,600
レノバ	47,400	1,010.00	47,874,000
東京瓦斯	345,900	3,337.00	1,154,268,300
大阪瓦斯	354,100	3,224.00	1,141,618,400
東邦瓦斯	76,900	3,969.00	305,216,100
北海道瓦斯	53,000	596.00	31,588,000
広島ガス	37,500	384.00	14,400,000
西部ガスホールディングス	18,500	1,825.00	33,762,500
静岡ガス	40,500	1,063.00	43,051,500
メタウォーター	21,300	1,780.00	37,914,000
SBSホールディングス	15,800	2,723.00	43,023,400
東武鉄道	195,200	2,503.00	488,585,600
相鉄ホールディングス	63,600	2,385.00	151,686,000
東急	498,200	1,853.00	923,164,600
京浜急行電鉄	219,900	1,169.50	257,173,050
小田急電鉄	293,800	1,599.00	469,786,200

京王電鉄	85,400	3,424.00	292,409,600	
京成電鉄	114,600	4,269.00	489,227,400	
富士急行	21,900	2,763.00	60,509,700	
東日本旅客鉄道	979,200	2,848.50	2,789,251,200	
西日本旅客鉄道	421,500	2,724.00	1,148,166,000	
東海旅客鉄道	684,400	3,317.00	2,270,154,800	
西武ホールディングス	214,900	3,191.00	685,745,900	
鴻池運輸	30,300	2,491.00	75,477,300	
西日本鉄道	47,500	2,288.00	108,680,000	
ハマキョウレックス	60,800	1,248.00	75,878,400	
サカイ引越センター	19,700	2,511.00	49,466,700	
近鉄グループホールディングス	177,400	3,566.00	632,608,400	
阪急阪神ホールディングス	236,500	4,422.00	1,045,803,000	
南海電気鉄道	79,100	2,359.50	186,636,450	
京阪ホールディングス	97,800	3,029.00	296,236,200	
神戸電鉄	4,800	2,524.00	12,115,200	
名古屋鉄道	183,000	1,741.00	318,603,000	
山陽電気鉄道	13,400	2,023.00	27,108,200	
アルプス物流	14,200	5,770.00	81,934,000	
ヤマトホールディングス	215,600	1,634.00	352,290,400	
山九	42,800	4,814.00	206,039,200	
丸運	2,200	490.00	1,078,000	
丸全昭和運輸	11,000	5,460.00	60,060,000	
センコーグループホールディングス	93,900	1,247.00	117,093,300	
トナミホールディングス	3,900	6,270.00	24,453,000	
ニッコンホールディングス	109,200	1,893.50	206,770,200	
日本石油輸送	400	2,830.00	1,132,000	
福山通運	16,300	3,800.00	61,940,000	
セイノーホールディングス	99,800	2,407.00	240,218,600	
神奈川中央交通	5,000	3,305.00	16,525,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	45,300	1,147.00	51,959,100	
九州旅客鉄道	125,400	4,135.00	518,529,000	
S Gホールディングス	297,800	1,541.00	458,909,800	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,200	7,541.00	499,214,200	
日本郵船	459,500	5,220.00	2,398,590,000	
商船三井	385,400	4,926.00	1,898,480,400	
川崎汽船	403,800	2,214.00	894,013,200	
N Sユナイテッド海運	9,700	4,510.00	43,747,000	
飯野海運	65,500	1,255.00	82,202,500	
共栄タンカー	1,000	1,025.00	1,025,000	
乾汽船	21,200	1,151.00	24,401,200	
日本航空	435,700	2,517.50	1,096,874,750	

ANAホールディングス	482,700	3,069.00	1,481,406,300
パスコ	700	2,137.00	1,495,900
トランコム	5,100	10,660.00	54,366,000
日新	13,500	4,140.00	55,890,000
三菱倉庫	42,300	5,222.00	220,890,600
三井倉庫ホールディングス	16,600	6,210.00	103,086,000
住友倉庫	47,400	2,693.00	127,648,200
澁澤倉庫	8,100	3,005.00	24,340,500
東陽倉庫	1,000	1,310.00	1,310,000
日本トランスシティ	35,700	880.00	31,416,000
ケイヒン	700	2,001.00	1,400,700
中央倉庫	9,500	1,388.00	13,186,000
川西倉庫	700	1,131.00	791,700
安田倉庫	12,100	1,616.00	19,553,600
ファイズホールディングス	600	847.00	508,200
東洋埠頭	1,100	1,280.00	1,408,000
上組	81,900	3,259.00	266,912,100
サンリツ	900	781.00	702,900
キムラユニティー	1,800	1,442.00	2,595,600
キューソー流通システム	11,800	1,965.00	23,187,000
東海運	2,200	322.00	708,400
エーアイティー	11,100	1,706.00	18,936,600
内外トランスライン	7,100	2,919.00	20,724,900
日本コンセプト	6,500	1,709.00	11,108,500
NEC ネットズエスアイ	69,500	2,769.00	192,445,500
クロスキャット	11,300	1,200.00	13,560,000
システナ	269,600	371.00	100,021,600
デジタルアーツ	11,300	4,930.00	55,709,000
日鉄ソリューションズ	60,800	3,735.00	227,088,000
キューブシステム	9,400	988.00	9,287,200
コア	7,900	1,899.00	15,002,100
手間いらず	3,000	3,475.00	10,425,000
ラクーンホールディングス	13,300	749.00	9,961,700
ソリトンシステムズ	9,200	1,062.00	9,770,400
ソフトクリエイイトホールディングス	14,700	1,846.00	27,136,200
T I S	188,400	3,651.00	687,848,400
テクミラホールディングス	1,800	343.00	617,400
グリー	59,700	468.00	27,939,600
GMOペパボ	2,200	1,338.00	2,943,600
コーエーテクモホールディングス	111,700	1,654.50	184,807,650
三菱総合研究所	8,700	4,160.00	36,192,000
電算	500	1,400.00	700,000

A G S	1,600	871.00	1,393,600
ファインデックス	14,200	856.00	12,155,200
ブレインパッド	14,800	843.00	12,476,400
K L a b	43,300	183.00	7,923,900
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	432.00	13,132,800
ネクソン	391,200	2,829.50	1,106,900,400
アイスタイル	59,600	541.00	32,243,600
エムアップホールディングス	21,800	1,325.00	28,885,000
エイチーム	11,900	611.00	7,270,900
エニグモ	22,700	329.00	7,468,300
テクノスジャパン	3,400	686.00	2,332,400
コロプラ	60,500	531.00	32,125,500
ブロードリーフ	71,600	667.00	47,757,200
クロス・マーケティンググループ	1,800	676.00	1,216,800
デジタルハーツホールディングス	11,100	845.00	9,379,500
メディアドゥ	8,100	1,376.00	11,145,600
じげん	52,000	605.00	31,460,000
ブイキューブ	24,600	217.00	5,338,200
エンカレッジ・テクノロジー	900	609.00	548,100
サイバーリンクス	1,500	737.00	1,105,500
フィックスターズ	17,900	1,597.00	28,586,300
C A R T A H O L D I N G S	10,100	1,402.00	14,160,200
オブティム	18,400	606.00	11,150,400
セレス	8,000	1,434.00	11,472,000
S H I F T	11,800	13,660.00	161,188,000
ティーガイア	18,600	3,670.00	68,262,000
セック	2,700	4,310.00	11,637,000
テクマトリックス	32,500	2,402.00	78,065,000
プロシップ	8,600	1,531.00	13,166,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,200	3,081.00	136,180,200
G M O ペイメントゲートウェイ	40,700	8,800.00	358,160,000
ザッパラス	900	378.00	340,200
システムリサーチ	12,200	1,420.00	17,324,000
インターネットイニシアティブ	85,200	3,020.00	257,304,000
さくらインターネット	22,300	4,290.00	95,667,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,887.00	15,589,800
S R A ホールディングス	9,100	4,270.00	38,857,000
システムインテグレータ	1,200	323.00	387,600
朝日ネット	19,200	636.00	12,211,200
e B A S E	25,100	617.00	15,486,700
アバントグループ	22,500	2,254.00	50,715,000
アドソル日進	7,500	1,737.00	13,027,500

ODKソリューションズ	800	583.00	466,400
フリービット	7,800	1,172.00	9,141,600
コムチュア	25,700	1,740.00	44,718,000
アステリア	14,000	541.00	7,574,000
アイル	10,000	2,972.00	29,720,000
マークラインズ	10,500	2,931.00	30,775,500
メディカル・データ・ビジョン	21,300	538.00	11,459,400
g u m i	29,000	332.00	9,628,000
ショーケース	900	302.00	271,800
モバイルファクトリー	800	837.00	669,600
テラスカイ	7,700	2,136.00	16,447,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,300	1,975.00	18,367,500
P C Iホールディングス	100	1,043.00	104,300
アイビーシー	600	543.00	325,800
ネオジャパン	5,900	1,919.00	11,322,100
P R T I M E S	3,600	1,736.00	6,249,600
ラクス	84,300	2,236.50	188,536,950
ランドコンピュータ	1,900	775.00	1,472,500
ダブルスタンダード	5,400	1,555.00	8,397,000
オープンドア	10,400	704.00	7,321,600
アカツキ	8,700	2,038.00	17,730,600
ベネフィットジャパン	200	1,139.00	227,800
U b i c o mホールディングス	5,700	1,432.00	8,162,400
カナミックネットワーク	22,400	534.00	11,961,600
ノムラシステムコーポレーション	4,300	111.00	477,300
チェンジホールディングス	39,300	1,395.00	54,823,500
シンクロ・フード	2,500	501.00	1,252,500
オークネット	8,200	2,430.00	19,926,000
キャピタル・アセット・プランニング	800	751.00	600,800
セグエグループ	3,500	583.00	2,040,500
エイトレッド	600	1,563.00	937,800
マクロミル	35,000	796.00	27,860,000
ビーグリー	700	1,392.00	974,400
オロ	7,500	2,596.00	19,470,000
ユーザーローカル	7,500	1,857.00	13,927,500
テモナ	900	184.00	165,600
ニーズウェル	4,200	301.00	1,264,200
マネーフォワード	43,600	5,857.00	255,365,200
サインポスト	1,500	498.00	747,000
S u n A s t e r i s k	12,700	524.00	6,654,800
プラスアルファ・コンサルティング	22,500	2,183.00	49,117,500
電算システムホールディングス	7,900	2,659.00	21,006,100

Appier Group	54,300	1,782.00	96,762,600
ビジョナル	21,100	7,930.00	167,323,000
ソルクシーズ	3,100	290.00	899,000
フェイス	1,100	392.00	431,200
プロトコーポレーション	19,500	1,485.00	28,957,500
ハイマックス	5,600	1,323.00	7,408,800
野村総合研究所	385,900	5,300.00	2,045,270,000
CEホールディングス	1,800	464.00	835,200
日本システム技術	16,500	1,968.00	32,472,000
インテージホールディングス	20,200	1,587.00	32,057,400
東邦システムサイエンス	8,300	1,404.00	11,653,200
ソースネクスト	81,600	198.00	16,156,800
シンプレクス・ホールディングス	27,100	2,420.00	65,582,000
HEROZ	7,000	1,036.00	7,252,000
ラクスル	43,100	1,306.00	56,288,600
メルカリ	87,000	2,507.00	218,109,000
IPS	5,100	2,167.00	11,051,700
FIG	4,500	316.00	1,422,000
システムサポート	6,900	1,955.00	13,489,500
イーソル	12,000	734.00	8,808,000
東海ソフト	600	1,238.00	742,800
ウイングアーク1st	18,500	3,205.00	59,292,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,000	863.00	5,178,000
サーバーワークス	3,700	2,879.00	10,652,300
東名	800	1,733.00	1,386,400
ヴィッツ	400	819.00	327,600
トピラシステムズ	1,100	757.00	832,700
Sansan	58,600	2,149.00	125,931,400
Link-Uグループ	800	497.00	397,600
ギフトィ	15,700	1,071.00	16,814,700
メドレー	19,600	3,825.00	74,970,000
ベース	8,700	3,115.00	27,100,500
JMDC	30,400	4,665.00	141,816,000
フォーカスシステムズ	11,900	1,114.00	13,256,600
クレスコ	29,200	1,362.00	39,770,400
フジ・メディア・ホールディングス	171,200	1,717.50	294,036,000
オービック	298,000	5,046.00	1,503,708,000
ジャストシステム	25,600	3,580.00	91,648,000
TDCソフト	33,400	1,245.00	41,583,000
LINEヤフー	2,537,300	419.30	1,063,889,890
トレンドマイクロ	93,600	8,486.00	794,289,600
IDホールディングス	12,000	1,392.00	16,704,000

日本オラクル	34,100	14,745.00	502,804,500
アルファシステムズ	4,700	2,905.00	13,653,500
フューチャー	44,300	1,820.00	80,626,000
C A C H o l d i n g s	10,900	1,771.00	19,303,900
トーセ	1,100	629.00	691,900
オービックビジネスコンサルタント	25,100	7,423.00	186,317,300
アイティフォー	22,800	1,376.00	31,372,800
東計電算	5,000	4,845.00	24,225,000
エクスネット	500	1,467.00	733,500
大塚商会	202,000	3,544.00	715,888,000
サイボウズ	24,500	1,957.00	47,946,500
電通総研	17,300	5,540.00	95,842,000
A C C E S S	18,500	1,434.00	26,529,000
デジタルガレージ	28,500	3,060.00	87,210,000
E M システムズ	29,700	507.00	15,057,900
ウェザーニューズ	5,500	5,790.00	31,845,000
C I J	44,400	417.00	18,514,800
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,230.00	17,766,000
日本エンタープライズ	4,100	119.00	487,900
WOWOW	13,400	1,035.00	13,869,000
スカラ	16,500	464.00	7,656,000
インテリジェント ウェイブ	2,000	908.00	1,816,000
A N Y C O L O R	25,400	2,505.00	63,627,000
I M A G I C A G R O U P	17,900	512.00	9,164,800
ネットワンシステムズ	69,400	3,579.00	248,382,600
システムソフト	62,200	63.00	3,918,600
アルゴグラフィックス	16,300	5,270.00	85,901,000
マーベラス	29,000	587.00	17,023,000
エイベックス	30,300	1,477.00	44,753,100
B I P R O G Y	53,500	4,860.00	260,010,000
都築電気	9,400	2,200.00	20,680,000
T B S ホールディングス	89,600	3,897.00	349,171,200
日本テレビホールディングス	157,800	2,244.50	354,182,100
朝日放送グループホールディングス	16,700	639.00	10,671,300
テレビ朝日ホールディングス	43,300	1,986.00	85,993,800
スカパーJ S A Tホールディングス	138,400	892.00	123,452,800
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,730.00	47,744,000
日本BS放送	1,400	888.00	1,243,200
ビジョン	26,700	1,251.00	33,401,700
スマートバリュー	1,100	320.00	352,000
U - N E X T H O L D I N G S	20,000	5,480.00	109,600,000
ワイヤレスゲート	1,900	239.00	454,100

日本通信	175,500	163.00	28,606,500
クロップス	500	989.00	494,500
日本電信電話	53,005,500	146.80	7,781,207,400
K D D I	1,310,700	4,594.00	6,021,355,800
ソフトバンク	28,482,000	187.20	5,331,830,400
光通信	17,600	31,870.00	560,912,000
エムティーアイ	12,200	1,156.00	14,103,200
GMOインターネットグループ	58,000	2,510.00	145,580,000
ファイバーゲート	9,600	1,020.00	9,792,000
アイドママーケティングコミュニケーション	1,100	222.00	244,200
K A D O K A W A	94,200	3,194.00	300,874,800
学研ホールディングス	32,600	1,007.00	32,828,200
ゼンリン	30,500	874.00	26,657,000
昭文社ホールディングス	1,700	391.00	664,700
インプレスホールディングス	3,900	151.00	588,900
アイネット	10,800	1,545.00	16,686,000
松竹	9,300	10,575.00	98,347,500
東宝	99,100	5,813.00	576,068,300
東映	29,400	4,550.00	133,770,000
N T T データグループ	465,900	2,574.50	1,199,459,550
ピー・シー・エー	10,200	2,060.00	21,012,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,814.00	12,698,000
D T S	35,200	4,050.00	142,560,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,400	5,695.00	463,573,000
シーイーシー	22,500	1,870.00	42,075,000
カブコン	318,700	3,328.00	1,060,633,600
アイ・エス・ビー	8,400	1,456.00	12,230,400
S C S K	124,700	2,959.50	369,049,650
N S W	7,900	3,025.00	23,897,500
アイネス	13,900	1,633.00	22,698,700
T K C	31,800	3,825.00	121,635,000
富士ソフト	49,300	9,020.00	444,686,000
N S D	62,900	3,165.00	199,078,500
コナミグループ	66,700	14,545.00	970,151,500
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,694.00	29,634,000
J B C C ホールディングス	11,800	4,270.00	50,386,000
ミロク情報サービス	16,200	1,855.00	30,051,000
ソフトバンクグループ	879,000	8,427.00	7,407,333,000
リョーサン菱洋ホールディングス	35,400	2,540.00	89,916,000
高千穂交易	7,400	3,905.00	28,897,000
オルバヘルスケアホールディングス	700	1,958.00	1,370,600
伊藤忠食品	4,200	7,190.00	30,198,000

エレマテック	16,900	1,728.00	29,203,200
あらた	28,800	3,630.00	104,544,000
トーメンデバイス	2,700	5,870.00	15,849,000
東京エレクトロン デバイス	18,700	3,600.00	67,320,000
円谷フィールズホールディングス	30,400	2,494.00	75,817,600
双日	209,300	3,365.00	704,294,500
アルフレッサ ホールディングス	188,700	2,256.00	425,707,200
横浜冷凍	47,300	949.00	44,887,700
ラサ商事	9,600	1,430.00	13,728,000
アルコニックス	24,800	1,363.00	33,802,400
神戸物産	145,400	4,524.00	657,789,600
ハイパー	900	324.00	291,600
あい ホールディングス	31,100	2,382.00	74,080,200
ディーブイエックス	1,100	930.00	1,023,000
ダイワボウホールディングス	83,200	2,717.50	226,096,000
マクニカホールディングス	133,500	1,986.00	265,131,000
ラクト・ジャパン	8,000	2,974.00	23,792,000
グリムス	7,900	2,831.00	22,364,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,199.00	34,171,500
八洲電機	15,200	1,728.00	26,265,600
メディアスホールディングス	10,900	829.00	9,036,100
レスター	16,000	2,710.00	43,360,000
ジオリーブグループ	900	1,133.00	1,019,700
大光	2,100	613.00	1,287,300
OCHIホールディングス	900	1,401.00	1,260,900
TOKAIホールディングス	102,100	971.00	99,139,100
黒谷	1,100	609.00	669,900
Cominix	800	900.00	720,000
三洋貿易	19,300	1,509.00	29,123,700
ビューティガレージ	5,900	1,603.00	9,457,700
ウイン・パートナーズ	12,200	1,186.00	14,469,200
ミタチ産業	1,100	1,175.00	1,292,500
シップヘルスケアホールディングス	67,600	2,338.50	158,082,600
明治電機工業	7,000	1,440.00	10,080,000
デリカフーズホールディングス	1,800	542.00	975,600
スターティアホールディングス	1,100	1,966.00	2,162,600
コメダホールディングス	46,100	2,766.00	127,512,600
ピーバンドットコム	500	361.00	180,500
アセンテック	7,200	606.00	4,363,200
富士興産	1,100	1,514.00	1,665,400
協栄産業	400	2,215.00	886,000
フルサト・マルカホールディングス	15,100	2,254.00	34,035,400

ヤマエグループホールディングス	16,600	2,033.00	33,747,800
小野建	18,900	1,488.00	28,123,200
南陽	1,700	1,041.00	1,769,700
佐島電機	13,100	1,916.00	25,099,600
エコートレーディング	800	929.00	743,200
伯東	10,800	4,675.00	50,490,000
コンドーテック	14,500	1,206.00	17,487,000
中山福	2,200	370.00	814,000
ナガイレーベン	23,700	2,536.00	60,103,200
三菱食品	17,400	5,260.00	91,524,000
松田産業	14,300	3,205.00	45,831,500
第一興商	72,700	1,742.00	126,643,400
メディバルホールディングス	191,100	2,490.50	475,934,550
S P K	8,300	1,938.00	16,085,400
萩原電気ホールディングス	8,100	3,420.00	27,702,000
アズワン	58,300	2,896.00	168,836,800
スズデン	6,600	1,772.00	11,695,200
尾家産業	1,000	1,978.00	1,978,000
シモジマ	12,600	1,302.00	16,405,200
ドウシシャ	17,400	2,153.00	37,462,200
小津産業	900	1,652.00	1,486,800
高速	11,200	2,534.00	28,380,800
たけびし	7,200	2,185.00	15,732,000
リックス	4,700	2,866.00	13,470,200
丸文	16,800	1,047.00	17,589,600
ハピネット	16,000	4,145.00	66,320,000
橋本総業ホールディングス	7,400	1,178.00	8,717,200
日本ライフライン	50,300	1,225.00	61,617,500
タカショー	16,400	480.00	7,872,000
I D O M	49,700	1,075.00	53,427,500
進和	11,500	2,574.00	29,601,000
エスケイジャパン	1,000	748.00	748,000
ダイトロン	8,200	2,824.00	23,156,800
シークス	26,800	1,105.00	29,614,000
田中商事	1,200	688.00	825,600
オーハシテクニカ	9,900	1,750.00	17,325,000
白銅	5,300	2,375.00	12,587,500
ダイコー通産	400	1,108.00	443,200
伊藤忠商事	1,263,600	7,678.00	9,701,920,800
丸紅	1,559,300	2,340.00	3,648,762,000
高島	2,700	1,228.00	3,315,600
長瀬産業	84,000	3,201.00	268,884,000

蝶理	11,800	3,755.00	44,309,000
豊田通商	494,000	2,585.00	1,276,990,000
三共生興	26,100	580.00	15,138,000
兼松	78,600	2,419.00	190,133,400
ツカモトコーポレーション	600	1,202.00	721,200
三井物産	2,816,000	3,178.00	8,949,248,000
日本紙パルプ商事	90,000	674.00	60,660,000
カメイ	20,000	1,942.00	38,840,000
東都水産	400	6,400.00	2,560,000
OUGホールディングス	600	2,539.00	1,523,400
スターゼン	13,000	2,904.00	37,752,000
山善	57,000	1,359.00	77,463,000
椿本興業	11,700	1,731.00	20,252,700
住友商事	1,125,900	3,194.00	3,596,124,600
内田洋行	7,600	6,800.00	51,680,000
三菱商事	3,609,600	2,952.50	10,657,344,000
第一実業	17,700	2,313.00	40,940,100
キャノンマーケティングジャパン	43,500	4,646.00	202,101,000
西華産業	7,400	3,975.00	29,415,000
佐藤商事	13,000	1,376.00	17,888,000
東京産業	17,200	690.00	11,868,000
ユアサ商事	14,700	4,980.00	73,206,000
神鋼商事	4,700	6,450.00	30,315,000
トルク	2,900	220.00	638,000
阪和興業	33,800	4,970.00	167,986,000
正栄食品工業	12,500	4,630.00	57,875,000
カナデン	14,100	1,434.00	20,219,400
RYODEN	15,200	2,468.00	37,513,600
岩谷産業	171,200	2,064.00	353,356,800
ナイス	1,300	1,868.00	2,428,400
ニチモウ	1,300	1,846.00	2,399,800
極東貿易	11,200	1,470.00	16,464,000
アステナホールディングス	35,400	513.00	18,160,200
三愛オブリ	43,900	1,945.00	85,385,500
稲畑産業	37,000	3,330.00	123,210,000
G S Iクレオス	10,100	1,996.00	20,159,600
明和産業	22,200	651.00	14,452,200
クワザワホールディングス	1,500	638.00	957,000
ワキタ	31,100	1,733.00	53,896,300
東邦ホールディングス	50,800	4,539.00	230,581,200
サンゲツ	43,300	2,813.00	121,802,900
ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,731.00	41,544,000

シナネンホールディングス	5,200	5,700.00	29,640,000
伊藤忠エネクス	46,600	1,558.00	72,602,800
サンリオ	152,700	4,130.00	630,651,000
サンワテクノス	9,600	1,908.00	18,316,800
新光商事	25,300	924.00	23,377,200
トーヨー	7,300	2,764.00	20,177,200
三信電気	7,600	1,987.00	15,101,200
東陽テクニカ	17,300	1,614.00	27,922,200
モスフードサービス	27,700	3,580.00	99,166,000
加賀電子	34,400	2,800.00	96,320,000
ソーダニッカ	19,900	1,160.00	23,084,000
立花エレテック	12,500	2,555.00	31,937,500
フォーバル	7,400	1,398.00	10,345,200
PALTAC	25,100	4,410.00	110,691,000
三谷産業	32,900	321.00	10,560,900
西本Wismettacホールディングス	11,500	1,368.00	15,732,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,805.00	841,500
コア商事ホールディングス	13,900	621.00	8,631,900
KPPグループホールディングス	48,700	674.00	32,823,800
ヤマタネ	8,300	3,040.00	25,232,000
丸紅建材リース	300	2,858.00	857,400
泉州電業	13,000	5,030.00	65,390,000
トラスコ中山	39,500	2,472.00	97,644,000
オートバックスセブン	65,400	1,480.00	96,792,000
モリト	15,000	1,392.00	20,880,000
加藤産業	23,300	4,240.00	98,792,000
北恵	1,000	938.00	938,000
イエローハット	29,900	2,600.00	77,740,000
JKホールディングス	14,500	998.00	14,471,000
日伝	12,300	3,350.00	41,205,000
北沢産業	2,500	350.00	875,000
杉本商事	18,200	1,372.00	24,970,400
因幡電機産業	48,700	3,830.00	186,521,000
東テク	18,800	2,656.00	49,932,800
ミスミグループ本社	284,000	2,590.00	735,560,000
アルテック	2,200	217.00	477,400
タキヒヨー	900	1,213.00	1,091,700
蔵王産業	700	2,501.00	1,750,700
スズケン	67,200	5,003.00	336,201,600
ジェコス	11,200	889.00	9,956,800
サンエー	28,800	2,575.00	74,160,000
カワチ薬品	14,800	2,698.00	39,930,400

エービーシー・マート	82,400	3,050.00	251,320,000
ハードオフコーポレーション	8,500	1,978.00	16,813,000
アスクル	45,600	2,163.00	98,632,800
ゲオホールディングス	21,300	1,539.00	32,780,700
アダストリア	22,800	3,335.00	76,038,000
くら寿司	22,100	3,760.00	83,096,000
キャンドウ	6,800	3,525.00	23,970,000
I Kホールディングス	2,200	360.00	792,000
パルグループホールディングス	37,000	2,538.00	93,906,000
エディオン	74,600	1,837.00	137,040,200
サーラコーポレーション	39,900	824.00	32,877,600
ワッツ	2,200	822.00	1,808,400
ハローズ	8,600	4,190.00	36,034,000
あみやき亭	13,800	1,896.00	26,164,800
大黒天物産	5,800	11,720.00	67,976,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,721.00	29,084,900
ファーマライズホールディングス	1,500	625.00	937,500
アルペン	15,700	2,133.00	33,488,100
ハブ	1,700	753.00	1,280,100
クオールホールディングス	26,100	1,418.00	37,009,800
ジinzホールディングス	14,400	5,260.00	75,744,000
ビックカメラ	112,700	1,583.00	178,404,100
D C Mホールディングス	97,600	1,579.00	154,110,400
Monotaro	266,600	2,397.50	639,173,500
東京一番フーズ	1,800	504.00	907,200
きちりホールディングス	1,100	880.00	968,000
J.フロント リテイリング	216,000	1,546.50	334,044,000
ドトール・日レスホールディングス	33,500	2,294.00	76,849,000
マツキヨココカラ&カンパニー	342,100	2,353.00	804,961,300
ブロンコビリー	11,100	3,765.00	41,791,500
Z O Z O	119,900	5,214.00	625,158,600
トレジャー・ファクトリー	13,200	1,775.00	23,430,000
物語コーポレーション	31,500	3,890.00	122,535,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,400	2,226.00	693,176,400
Hamee	7,900	1,055.00	8,334,500
マーケットエンタープライズ	700	948.00	663,600
ウエルシアホールディングス	97,700	2,038.00	199,112,600
クリエイトSDホールディングス	26,800	3,205.00	85,894,000
丸善CHIホールディングス	5,800	327.00	1,896,600
ミサワ	1,400	651.00	911,400
ティーライフ	800	1,127.00	901,600
チムニー	1,200	1,296.00	1,555,200

シュッピン	17,300	1,249.00	21,607,700
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,420.00	36,210,000
ネクステージ	43,200	1,837.00	79,358,400
ジョイフル本田	52,300	2,083.00	108,940,900
エターナルホスピタリティグループ	7,100	4,085.00	29,003,500
ホットランド	14,600	2,366.00	34,543,600
すかいらーくホールディングス	257,100	2,310.50	594,029,550
SFPホールディングス	9,100	1,977.00	17,990,700
綿半ホールディングス	14,800	1,721.00	25,470,800
ヨシックスホールディングス	4,900	3,410.00	16,709,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	848.00	44,859,200
B E E N O S	11,300	2,644.00	29,877,200
あさひ	17,700	1,723.00	30,497,100
日本調剤	12,700	1,353.00	17,183,100
コスモス薬品	31,900	7,487.00	238,835,300
トーエル	2,200	805.00	1,771,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,903,600	2,147.00	4,087,029,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	127,300	1,128.00	143,594,400
ツルハホールディングス	39,500	9,070.00	358,265,000
サンマルクホールディングス	15,300	2,170.00	33,201,000
フェリシモ	1,300	904.00	1,175,200
トリドールホールディングス	52,800	3,720.00	196,416,000
T O K Y O B A S E	21,600	242.00	5,227,200
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,189.00	1,307,900
J Mホールディングス	14,300	3,210.00	45,903,000
サツドラホールディングス	2,000	800.00	1,600,000
アレンザホールディングス	14,400	1,100.00	15,840,000
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,519.00	8,962,100
パロックジャパンリミテッド	15,100	762.00	11,506,200
クスリのアオキホールディングス	63,000	3,333.00	209,979,000
力の源ホールディングス	12,100	1,190.00	14,399,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	100,400	2,877.50	288,901,000
メディカルシステムネットワーク	21,200	433.00	9,179,600
はるやまホールディングス	2,500	578.00	1,445,000
ノジマ	54,700	2,026.00	110,822,200
カップ・クリエイト	29,500	1,676.00	49,442,000
ライトオン	3,000	319.00	957,000
良品計画	224,000	2,634.00	590,016,000
パリティホールディングス	5,900	334.00	1,970,600
アドヴァングループ	16,500	899.00	14,833,500

アルビス	6,300	2,753.00	17,343,900
コナカ	4,800	245.00	1,176,000
ハウス オブ ローゼ	700	1,506.00	1,054,200
G - 7ホールディングス	20,700	1,669.00	34,548,300
イオン北海道	55,700	920.00	51,244,000
コジマ	36,600	959.00	35,099,400
ヒマラヤ	1,800	876.00	1,576,800
コーナン商事	23,100	3,805.00	87,895,500
エコス	7,100	2,119.00	15,044,900
ワタミ	19,900	868.00	17,273,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	379,800	3,695.00	1,403,361,000
西松屋チェーン	37,100	2,464.00	91,414,400
ゼンショーホールディングス	95,800	7,936.00	760,268,800
幸楽苑ホールディングス	13,900	1,231.00	17,110,900
ハークスレイ	1,700	740.00	1,258,000
サイゼリヤ	27,900	5,710.00	159,309,000
V Tホールディングス	74,100	470.00	34,827,000
魚力	6,700	2,442.00	16,361,400
フジ・コーポレーション	9,100	2,032.00	18,491,200
ユナイテッドアローズ	22,200	2,071.00	45,976,200
ハイデイ日高	28,000	2,696.00	75,488,000
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	85.00	416,500
コロワイド	96,600	1,728.50	166,973,100
壱番屋	74,600	1,041.00	77,658,600
P L A N T	1,100	1,483.00	1,631,300
スギホールディングス	113,800	2,665.50	303,333,900
薬王堂ホールディングス	9,300	2,468.00	22,952,400
スクロール	28,400	965.00	27,406,000
ヨンドシーホールディングス	18,000	1,863.00	33,534,000
木曽路	28,600	2,406.00	68,811,600
S R Sホールディングス	31,300	1,197.00	37,466,100
千趣会	38,000	303.00	11,514,000
リテールパートナーズ	28,200	1,367.00	38,549,400
上新電機	18,700	2,706.00	50,602,200
日本瓦斯	99,500	2,297.00	228,551,500
ロイヤルホールディングス	33,100	2,474.00	81,889,400
いなげや	18,300	1,219.00	22,307,700
チヨダ	18,400	984.00	18,105,600
ライフコーポレーション	19,700	3,630.00	71,511,000
リンガーハット	24,200	2,198.00	53,191,600
Mr Max HD	24,200	724.00	17,520,800
A O K Iホールディングス	40,600	1,194.00	48,476,400

オークワ	27,100	887.00	24,037,700
コメリ	29,000	3,700.00	107,300,000
青山商事	40,500	1,347.00	54,553,500
しまむら	44,200	7,824.00	345,820,800
はせがわ	2,900	328.00	951,200
高島屋	239,500	1,143.00	273,748,500
松屋	31,900	865.00	27,593,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	95,900	2,058.00	197,362,200
近鉄百貨店	8,200	2,111.00	17,310,200
丸井グループ	124,800	2,390.50	298,334,400
アクシアル リテイリング	51,700	940.00	48,598,000
イオン	637,300	3,899.00	2,484,832,700
イズミ	33,300	3,547.00	118,115,100
平和堂	31,400	2,390.00	75,046,000
フジ	28,900	2,115.00	61,123,500
ヤオコー	22,300	9,722.00	216,800,600
ゼビオホールディングス	25,800	1,254.00	32,353,200
ケーズホールディングス	126,500	1,542.50	195,126,250
Olympicグループ	2,400	498.00	1,195,200
日産東京販売ホールディングス	6,700	439.00	2,941,300
シルバーライフ	5,500	804.00	4,422,000
Genky DrugStores	16,600	3,745.00	62,167,000
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,237.00	1,113,300
ブックオフグループホールディングス	13,900	1,363.00	18,945,700
ギフトホールディングス	9,400	2,827.00	26,573,800
アインホールディングス	26,000	5,434.00	141,284,000
Genki Global Dining	10,700	4,445.00	47,561,500
ヤマダホールディングス	579,000	448.70	259,797,300
アークランズ	56,100	1,753.00	98,343,300
ニトリホールディングス	68,500	21,795.00	1,492,957,500
グルメ杵屋	15,600	1,049.00	16,364,400
愛眼	3,000	160.00	480,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,056.00	9,609,600
吉野家ホールディングス	69,400	3,141.00	217,985,400
松屋フーズホールディングス	8,900	6,290.00	55,981,000
サガミホールディングス	28,400	1,653.00	46,945,200
王将フードサービス	42,000	2,849.00	119,658,000
ミニストップ	13,700	1,614.00	22,111,800
アークス	34,600	2,561.00	88,610,600
パローホールディングス	36,000	2,203.00	79,308,000
ベルク	9,400	6,430.00	60,442,000
大庄	11,600	1,072.00	12,435,200

ファーストリテイリング	105,700	47,420.00	5,012,294,000
サンドラッグ	63,500	4,234.00	268,859,000
サクスパー ホールディングス	16,300	833.00	13,577,900
ヤマザワ	1,100	1,209.00	1,329,900
やまや	900	3,000.00	2,700,000
ペルーナ	45,700	723.00	33,041,100
いよぎんホールディングス	208,200	1,359.00	282,943,800
しずおかフィナンシャルグループ	385,400	1,244.50	479,630,300
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,300	1,429.00	210,491,700
楽天銀行	81,200	3,225.00	261,870,000
京都フィナンシャルグループ	220,300	2,204.50	485,651,350
島根銀行	1,100	510.00	561,000
じもとホールディングス	3,300	282.00	930,600
めぶきフィナンシャルグループ	810,900	574.50	465,862,050
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	4,135.00	92,624,000
九州フィナンシャルグループ	338,700	697.10	236,107,770
ゆうちょ銀行	1,922,900	1,338.00	2,572,840,200
富山第一銀行	55,500	1,061.00	58,885,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	930,900	792.00	737,272,800
西日本フィナンシャルホールディングス	97,900	1,632.00	159,772,800
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,647.00	25,693,200
第四北越フィナンシャルグループ	55,000	2,351.00	129,305,000
ひろぎんホールディングス	249,100	1,106.00	275,504,600
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,278.00	33,942,200
十六フィナンシャルグループ	22,700	3,950.00	89,665,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	4,255.00	72,760,500
プロクレアホールディングス	20,000	1,756.00	35,120,000
あいちフィナンシャルグループ	35,900	2,356.00	84,580,400
あおぞら銀行	125,800	2,664.00	335,131,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,656,700	1,453.50	15,489,513,450
りそなホールディングス	2,006,800	997.60	2,001,983,680
三井住友トラスト・ホールディングス	623,100	3,391.00	2,112,932,100
三井住友フィナンシャルグループ	3,648,600	3,045.00	11,109,987,000
千葉銀行	487,700	1,152.50	562,074,250
群馬銀行	339,600	877.80	298,100,880
武蔵野銀行	24,400	2,665.00	65,026,000
千葉興業銀行	41,300	1,039.00	42,910,700
筑波銀行	76,800	236.00	18,124,800
七十七銀行	50,900	3,915.00	199,273,500
秋田銀行	11,700	2,172.00	25,412,400
山形銀行	19,400	1,011.00	19,613,400
岩手銀行	11,100	2,266.00	25,152,600

東邦銀行	138,400	262.00	36,260,800
東北銀行	1,800	1,110.00	1,998,000
ふくおかフィナンシャルグループ	152,400	3,671.00	559,460,400
スルガ銀行	131,000	1,115.00	146,065,000
八十二銀行	375,500	840.50	315,607,750
山梨中央銀行	19,600	1,600.00	31,360,000
大垣共立銀行	33,400	1,822.00	60,854,800
福井銀行	15,600	1,835.00	28,626,000
清水銀行	7,000	1,474.00	10,318,000
富山銀行	600	1,609.00	965,400
滋賀銀行	29,100	3,245.00	94,429,500
南都銀行	26,300	3,010.00	79,163,000
百五銀行	164,600	545.00	89,707,000
紀陽銀行	62,600	1,675.00	104,855,000
ほくほくフィナンシャルグループ	108,300	1,562.50	169,218,750
山陰合同銀行	109,500	1,220.00	133,590,000
鳥取銀行	1,300	1,328.00	1,726,400
百十四銀行	17,200	2,475.00	42,570,000
四国銀行	25,700	963.00	24,749,100
阿波銀行	24,500	2,448.00	59,976,000
大分銀行	10,500	3,075.00	32,287,500
宮崎銀行	10,500	2,675.00	28,087,500
佐賀銀行	10,200	2,085.00	21,267,000
琉球銀行	37,200	994.00	36,976,800
セブン銀行	548,500	286.30	157,035,550
みずほフィナンシャルグループ	2,362,000	2,936.00	6,934,832,000
高知銀行	1,300	790.00	1,027,000
山口フィナンシャルグループ	171,600	1,549.50	265,894,200
名古屋銀行	11,100	6,200.00	68,820,000
北洋銀行	265,100	386.00	102,328,600
大光銀行	1,200	1,334.00	1,600,800
愛媛銀行	23,600	1,039.00	24,520,400
トマト銀行	1,300	1,143.00	1,485,900
京葉銀行	72,000	700.00	50,400,000
栃木銀行	87,400	263.00	22,986,200
北日本銀行	5,700	2,375.00	13,537,500
東和銀行	32,100	590.00	18,939,000
福島銀行	3,900	243.00	947,700
大東銀行	1,600	699.00	1,118,400
トモニホールディングス	165,600	372.00	61,603,200
フィデアホールディングス	18,100	1,421.00	25,720,100
池田泉州ホールディングス	242,700	325.00	78,877,500

F P G	62,400	2,220.00	138,528,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,400	1,055.00	29,962,000
マーキュリアホールディングス	1,700	859.00	1,460,300
S B I ホールディングス	281,100	3,295.00	926,224,500
ジャフコ グループ	52,200	2,022.00	105,548,400
大和証券グループ本社	1,355,600	1,005.00	1,362,378,000
野村ホールディングス	2,942,800	743.00	2,186,500,400
岡三証券グループ	153,700	620.00	95,294,000
丸三証券	58,300	920.00	53,636,000
東洋証券	46,600	417.00	19,432,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,900	483.00	100,415,700
光世証券	1,000	435.00	435,000
水戸証券	48,100	466.00	22,414,600
いちよし証券	32,800	674.00	22,107,200
松井証券	86,200	782.00	67,408,400
マネックスグループ	171,500	602.00	103,243,000
極東証券	24,000	1,390.00	33,360,000
岩井コスモホールディングス	20,000	1,995.00	39,900,000
アイザワ証券グループ	25,300	1,768.00	44,730,400
マネーパートナーズグループ	4,100	219.00	897,900
スパークス・グループ	19,500	1,315.00	25,642,500
かんぽ生命保険	178,200	2,604.00	464,032,800
F P パートナー	7,700	2,685.00	20,674,500
S O M P O ホールディングス	789,700	3,201.00	2,527,829,700
アニコム ホールディングス	59,400	678.00	40,273,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,175,300	3,330.00	3,913,749,000
第一生命ホールディングス	822,800	3,682.00	3,029,549,600
東京海上ホールディングス	1,708,500	5,231.00	8,937,163,500
T & D ホールディングス	469,900	2,495.00	1,172,400,500
アドバンスクリエイト	13,600	936.00	12,729,600
N E X Y Z . G r o u p	2,000	856.00	1,712,000
全国保証	45,900	5,644.00	259,059,600
あんしん保証	4,300	183.00	786,900
イントラスト	2,200	747.00	1,643,400
日本モーゲージサービス	3,400	421.00	1,431,400
C a s a	2,100	835.00	1,753,500
S B I アルヒ	17,500	814.00	14,245,000
プレミアグループ	29,900	2,118.00	63,328,200
ネットプロテクションズホールディングス	60,400	339.00	20,475,600
クレディセゾン	111,100	3,581.00	397,849,100
芙蓉総合リース	16,200	11,000.00	178,200,000
みずほリース	147,200	987.00	145,286,400

東京センチュリー	131,100	1,606.00	210,546,600
日本証券金融	64,700	1,915.00	123,900,500
アイフル	259,500	322.00	83,559,000
リコーリース	16,700	4,945.00	82,581,500
イオンフィナンシャルサービス	101,000	1,258.00	127,058,000
アコム	314,000	381.20	119,696,800
ジャックス	18,800	3,845.00	72,286,000
オリエントコーポレーション	57,800	938.00	54,216,400
オリックス	1,049,600	3,318.00	3,482,572,800
三菱HCキャピタル	780,300	1,010.50	788,493,150
九州リースサービス	2,100	997.00	2,093,700
日本取引所グループ	902,600	1,855.50	1,674,774,300
イー・ギャランティ	29,000	1,419.00	41,151,000
アサックス	2,400	727.00	1,744,800
NECキャピタルソリューション	8,800	3,755.00	33,044,000
robot home	52,600	141.00	7,416,600
大東建託	64,100	17,410.00	1,115,981,000
サムティホールディングス	34,300	2,792.00	95,765,600
いちご	179,400	367.00	65,839,800
日本駐車場開発	211,100	232.00	48,975,200
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	605.00	11,555,500
SREホールディングス	7,700	4,410.00	33,957,000
ADワークスグループ	9,500	209.00	1,985,500
ヒューリック	408,600	1,454.50	594,308,700
野村不動産ホールディングス	97,600	3,831.00	373,905,600
三重交通グループホールディングス	38,700	499.00	19,311,300
ディア・ライフ	30,500	822.00	25,071,000
地主	15,800	2,097.00	33,132,600
プレサンスコーポレーション	23,500	1,922.00	45,167,000
ハウスコム	1,200	1,059.00	1,270,800
JPMC	10,600	1,160.00	12,296,000
サンセイランディック	1,800	955.00	1,719,000
フージャースホールディングス	27,000	1,040.00	28,080,000
オープンハウスグループ	64,200	5,405.00	347,001,000
東急不動産ホールディングス	526,700	986.00	519,326,200
飯田グループホールディングス	167,900	2,211.00	371,226,900
イーランド	1,000	1,429.00	1,429,000
ムゲンエステート	3,300	1,625.00	5,362,500
And Doホールディングス	10,600	1,044.00	11,066,400
シーアールイー	8,200	1,312.00	10,758,400
ケイアイスター不動産	8,600	3,910.00	33,626,000
グッドコムアセット	15,000	880.00	13,200,000

ジェイ・エス・ビー	7,500	2,817.00	21,127,500
ロードスターキャピタル	10,200	2,308.00	23,541,600
テンポイノベーション	1,800	945.00	1,701,000
フェイスネットワーク	1,400	1,692.00	2,368,800
霞ヶ関キャピタル	7,200	14,980.00	107,856,000
パーク24	136,700	1,792.50	245,034,750
パラカ	5,800	1,726.00	10,010,800
三井不動産	2,427,900	1,338.00	3,248,530,200
三菱地所	1,098,300	2,258.50	2,480,510,550
平和不動産	28,600	4,080.00	116,688,000
東京建物	153,100	2,296.50	351,594,150
京阪神ビルディング	33,100	1,606.00	53,158,600
住友不動産	253,200	4,806.00	1,216,879,200
テーオーシー	32,200	624.00	20,092,800
レオパレス21	175,100	598.00	104,709,800
スターツコーポレーション	25,300	3,475.00	87,917,500
フジ住宅	22,900	718.00	16,442,200
空港施設	25,700	572.00	14,700,400
明和地所	13,100	966.00	12,654,600
ゴールドクレスト	14,500	3,245.00	47,052,500
エスリード	8,400	4,760.00	39,984,000
日神グループホールディングス	29,300	495.00	14,503,500
日本エスコン	32,700	1,032.00	33,746,400
MIRARTHホールディングス	91,000	503.00	45,773,000
AVANTIA	2,800	776.00	2,172,800
イオンモール	91,000	2,091.00	190,281,000
毎日コムネット	2,100	735.00	1,543,500
ファースト住建	2,100	1,120.00	2,352,000
カチタス	47,400	1,991.00	94,373,400
トーセイ	29,400	2,300.00	67,620,000
穴吹興産	1,200	2,026.00	2,431,200
サンフロンティア不動産	26,300	1,758.00	46,235,400
FJネクストホールディングス	18,900	1,213.00	22,925,700
インテリックス	900	707.00	636,300
ランドビジネス	1,400	200.00	280,000
サンネクスタグループ	1,800	1,018.00	1,832,400
グランディハウス	17,500	556.00	9,730,000
日本空港ビルデング	62,000	5,153.00	319,486,000
明豊ファシリティワークス	2,200	858.00	1,887,600
LIFULL	45,900	142.00	6,517,800
MIXI	39,300	2,760.00	108,468,000
ジェイエシーリクルートメント	66,200	764.00	50,576,800

日本M&Aセンターホールディングス	291,300	654.70	190,714,110
メンバーズ	6,400	925.00	5,920,000
中広	900	502.00	451,800
UTグループ	23,900	2,752.00	65,772,800
アイティメディア	7,100	1,625.00	11,537,500
ケアネット	37,700	629.00	23,713,300
E・Jホールディングス	10,800	1,810.00	19,548,000
オープンアップグループ	55,000	2,044.00	112,420,000
コシダカホールディングス	54,900	1,015.00	55,723,500
アルトナー	1,700	1,815.00	3,085,500
パソナグループ	22,200	2,199.00	48,817,800
CDS	1,300	1,818.00	2,363,400
リンクアンドモチベーション	45,100	632.00	28,503,200
エス・エム・エス	64,100	2,156.50	138,231,650
サニーサイドアップグループ	1,600	583.00	932,800
パーソルホールディングス	1,860,000	256.80	477,648,000
リニカル	3,000	389.00	1,167,000
クックパッド	50,900	177.00	9,009,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	806.00	2,337,400
学情	9,400	1,783.00	16,760,200
スタジオアリス	9,200	2,064.00	18,988,800
エプコ	1,300	820.00	1,066,000
NJS	4,600	3,420.00	15,732,000
総合警備保障	305,300	1,035.00	315,985,500
カカクコム	118,600	2,491.50	295,491,900
アイロムグループ	7,400	2,775.00	20,535,000
セントケア・ホールディング	13,500	751.00	10,138,500
サイネックス	900	854.00	768,600
ルネサンス	14,400	1,006.00	14,486,400
ディップ	28,000	2,840.00	79,520,000
デジタルホールディングス	9,500	934.00	8,873,000
新日本科学	16,800	1,165.00	19,572,000
キャリアデザインセンター	800	1,726.00	1,380,800
エムスリー	361,100	1,438.00	519,261,800
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	411.00	1,274,100
ウェルネット	3,700	739.00	2,734,300
ワールドホールディングス	7,300	1,948.00	14,220,400
ディー・エヌ・エー	65,000	1,783.00	115,895,000
博報堂DYホールディングス	233,100	1,169.00	272,493,900
ぐるなび	34,500	340.00	11,730,000
タカミヤ	25,200	431.00	10,861,200
ファンコミュニケーションズ	26,000	404.00	10,504,000

ライク	6,900	1,446.00	9,977,400
A o b a - B B T	2,000	325.00	650,000
エスプール	58,300	340.00	19,822,000
W D B ホールディングス	9,400	1,710.00	16,074,000
ティア	3,000	456.00	1,368,000
アドウェイズ	22,800	332.00	7,569,600
バリューコマース	16,200	1,121.00	18,160,200
インフォマート	172,900	327.00	56,538,300
J P ホールディングス	47,000	725.00	34,075,000
エコナックホールディングス	4,800	115.00	552,000
C L ホールディングス	4,500	956.00	4,302,000
プレステージ・インターナショナル	85,700	703.00	60,247,100
アミューズ	11,300	1,400.00	15,820,000
ドリームインキュベータ	5,800	2,253.00	13,067,400
クイック	12,800	2,078.00	26,598,400
T A C	2,900	163.00	472,700
電通グループ	197,500	4,407.00	870,382,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,000	828.00	7,452,000
イオンファンタジー	6,700	2,271.00	15,215,700
シーティーエス	22,800	826.00	18,832,800
H . U . グループホールディングス	53,500	2,651.50	141,855,250
アルプス技研	16,000	2,777.00	44,432,000
日本空調サービス	19,800	1,047.00	20,730,600
オリエンタルランド	966,600	3,698.00	3,574,486,800
ダスキン	39,900	3,860.00	154,014,000
明光ネットワークジャパン	22,400	680.00	15,232,000
ファルコホールディングス	8,200	2,355.00	19,311,000
ラウンドワン	172,500	1,095.00	188,887,500
リゾートトラスト	79,400	2,876.00	228,354,400
ビー・エム・エル	22,500	2,652.00	59,670,000
リソー教育	94,100	258.00	24,277,800
早稲田アカデミー	10,200	1,588.00	16,197,600
ユー・エス・エス	409,900	1,356.50	556,029,350
東京個別指導学院	22,100	406.00	8,972,600
サイバーエージェント	403,800	1,019.50	411,674,100
楽天グループ	1,285,600	925.60	1,189,951,360
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,464.00	13,615,200
S B I グローバルアセットマネジメント	36,100	588.00	21,226,800
テー・オー・ダブリュー	36,400	329.00	11,975,600
山田コンサルティンググループ	8,000	2,251.00	18,008,000
セントラルスポーツ	6,900	2,425.00	16,732,500
フルキャストホールディングス	15,100	1,604.00	24,220,400

エン・ジャパン	29,800	2,432.00	72,473,600
リソルホールディングス	400	4,585.00	1,834,000
テクノプロ・ホールディングス	106,100	2,779.00	294,851,900
アトラグループ	1,500	135.00	202,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	879.00	8,526,300
K e e P e r 技研	11,300	4,285.00	48,420,500
ファーストロジック	1,500	777.00	1,165,500
三機サービス	800	976.00	780,800
G u n o s y	14,700	792.00	11,642,400
デザインワン・ジャパン	2,500	125.00	312,500
イー・ガーディアン	8,800	1,756.00	15,452,800
リブセンス	3,000	166.00	498,000
ジャパンマテリアル	56,000	1,853.00	103,768,000
ベクトル	22,000	915.00	20,130,000
ウチヤマホールディングス	2,200	335.00	737,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,374.00	21,022,200
キャリアリンク	6,800	2,433.00	16,544,400
I B J	14,200	723.00	10,266,600
アサンテ	9,100	1,628.00	14,814,800
バリューHR	16,500	1,608.00	26,532,000
M & A キャピタルパートナーズ	14,900	2,307.00	34,374,300
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,000.00	7,400,000
E R I ホールディングス	1,200	1,950.00	2,340,000
アビスト	700	3,170.00	2,219,000
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,682.00	40,368,000
ウィルグループ	15,500	988.00	15,314,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	145.00	870,000
メドピア	14,900	562.00	8,373,800
レアジョブ	1,200	403.00	483,600
リクルートホールディングス	1,315,400	8,705.00	11,450,557,000
エラン	24,400	996.00	24,302,400
土木管理総合試験所	2,400	316.00	758,400
日本郵政	1,909,400	1,366.00	2,608,240,400
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,505.00	29,648,500
鎌倉新書	16,000	534.00	8,544,000
S M N	1,400	278.00	389,200
グローバルキッズCOMPANY	1,000	679.00	679,000
エアトリ	13,500	1,217.00	16,429,500
アトラエ	13,500	850.00	11,475,000
ストライク	9,000	4,350.00	39,150,000
ソラスト	50,700	558.00	28,290,600
セラク	5,700	1,458.00	8,310,600

インソース	39,800	1,022.00	40,675,600
ベイカレント	134,300	5,304.00	712,327,200
Orchestra Holdings	4,200	857.00	3,599,400
アイモバイル	23,600	522.00	12,319,200
キャリアインデックス	2,300	182.00	418,600
MS - Japan	8,500	1,014.00	8,619,000
船場	1,000	1,212.00	1,212,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,200	3,110.00	184,112,000
フルテック	700	1,156.00	809,200
GameWith	2,400	287.00	688,800
MS&Consulting	800	504.00	403,200
エル・ティー・エス	2,500	1,936.00	4,840,000
ミダックホールディングス	11,200	1,775.00	19,880,000
キュービーネットホールディングス	10,600	1,085.00	11,501,000
オープングループ	25,700	199.00	5,114,300
スプリックス	1,400	795.00	1,113,000
マネジメントソリューションズ	9,100	1,649.00	15,005,900
プロレド・パートナーズ	4,800	527.00	2,529,600
テノ・ホールディングス	900	490.00	441,000
フロンティア・マネジメント	5,600	1,233.00	6,904,800
コプロ・ホールディングス	1,400	1,477.00	2,067,800
ギークス	900	416.00	374,400
アンビスホールディングス	39,200	1,926.00	75,499,200
カーブスホールディングス	50,100	755.00	37,825,500
フォーラムエンジニアリング	25,000	932.00	23,300,000
Fast Fitness Japan	6,400	1,357.00	8,684,800
Macbee Planet	5,200	2,643.00	13,743,600
ダイレクトマーケティングミックス	22,900	252.00	5,770,800
ポピンズ	3,500	1,386.00	4,851,000
LITALICO	14,400	1,246.00	17,942,400
コンフィデンス・インターワークス	400	1,740.00	696,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	530.00	1,219,000
リログループ	91,600	1,878.00	172,024,800
東祥	13,000	681.00	8,853,000
ID&Eホールディングス	11,100	4,280.00	47,508,000
ビーウィズ	3,800	1,908.00	7,250,400
サンウェルズ	7,100	1,617.00	11,480,700
TREホールディングス	35,100	1,651.00	57,950,100
人・夢・技術グループ	7,600	1,721.00	13,079,600
NISSOホールディングス	16,100	809.00	13,024,900
大栄環境	33,200	3,110.00	103,252,000
日本管財ホールディングス	19,200	2,680.00	51,456,000

M & A 総研ホールディングス	19,800	2,985.00	59,103,000	
エイチ・アイ・エス	58,500	1,683.00	98,455,500	
ラックランド	8,300	2,018.00	16,749,400	
共立メンテナンス	57,400	2,402.00	137,874,800	
イチネンホールディングス	19,500	1,834.00	35,763,000	
建設技術研究所	9,400	4,520.00	42,488,000	
スペース	13,400	1,222.00	16,374,800	
燦ホールディングス	17,000	1,181.00	20,077,000	
スバル興業	7,100	3,025.00	21,477,500	
東京テアトル	1,400	1,086.00	1,520,400	
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,252.00	10,016,000	
ナガワ	5,700	7,340.00	41,838,000	
東京都競馬	13,400	4,385.00	58,759,000	
カナモト	28,400	2,975.00	84,490,000	
ニシオホールディングス	15,100	4,015.00	60,626,500	
トランス・コスモス	20,500	3,545.00	72,672,500	
乃村工藝社	79,900	818.00	65,358,200	
藤田観光	8,100	9,710.00	78,651,000	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,345.00	14,660,500	
トーカイ	16,200	2,145.00	34,749,000	
セコム	372,000	5,294.00	1,969,368,000	
セントラル警備保障	9,900	2,847.00	28,185,300	
丹青社	35,600	835.00	29,726,000	
メイテックグループホールディングス	62,200	3,171.00	197,236,200	
応用地質	17,100	2,722.00	46,546,200	
船井総研ホールディングス	36,600	2,412.00	88,279,200	
進学会ホールディングス	1,800	227.00	408,600	
オオバ	2,800	1,019.00	2,853,200	
いであ	1,100	2,402.00	2,642,200	
学究社	7,400	1,943.00	14,378,200	
イオンディライト	19,600	4,055.00	79,478,000	
ナック	15,800	549.00	8,674,200	
ダイセキ	37,300	3,745.00	139,688,500	
ステップ	6,700	1,933.00	12,951,100	
合 計	329,583,100		661,440,523,950	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

(2024年10月31日現在)

資産総額	16,978,408,803円
負債総額	32,301,499円
純資産総額（ - ）	16,946,107,304円
発行済口数	4,838,843,859口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5021円
（1万口当たり純資産額）	（35,021円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年10月31日現在)

資産総額	701,956,356,932円
負債総額	14,487,710,225円
純資産総額（ - ）	687,468,646,707円
発行済口数	242,992,530,472口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8292円
（1万口当たり純資産額）	（28,292円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿

に記載又は記録するものとし、ただし、上記イ.の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとし、

- 八.上記イ.の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとし、

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年10月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2024年12月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2024年10月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	534	15,781,451
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	59	205,224
単体型公社債投資信託	52	171,223
合計	645	16,157,898

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金			
		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	510	460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種 類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)*2、*3及び(注2)参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

2. その他有価証券

前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりませ

ん。
なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
合計		7,458	-	48	48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度(2024年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
----	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
	合計	12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
合計			5,082	-	88

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表
該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券報告書(内国投資信託受益証券)	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

- (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2024年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年12月27日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2024年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年12月28日	有価証券届出書
2023年12月28日	有価証券報告書
2024年 6月28日	有価証券届出書
2024年 6月28日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年12月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2023年10月3日から2024年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2024年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。